

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2月7日提出
【計算期間】	第32期(自 2018年11月8日至 2019年11月7日)
【ファンド名】	インデックスポートフォリオ バランスポートフォリオ
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

インデックスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
バランスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果に、内外公社債への投資による安定性を加味した運用を行ない、信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざします。

ファンドの基本的性格

<インデックスポートフォリオ>

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券 不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 () 資産複合	特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

国内

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

株式

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

インデックス型

目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株 中小型株	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年5回	欧州		
公債	(隔月)			
社債		アジア		
その他債券	年12回			TOPIX
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米		
	その他	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	()	中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(株式 一般))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式に投資を行いません。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「株式」に分類されます。

年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

日本

目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド

目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。

< バランスポートフォリオ >

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファ

ンドをいいます。

国内

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式	年1回	グローバル	
一般			
大型株	年2回	日本	
中小型株			
	年4回	北米	
債券			ファミリーファンド
一般	年6回	欧州	
公債	(隔月)		
社債		アジア	
その他債券	年12回		
クレジット属性	(毎月)	オセアニア	
()			
	日々	中南米	
不動産投信			ファンド・オブ・ファンズ
	その他	アフリカ	
()			
その他資産		中近東	
(投資信託証券(資産複合 資産配分		(中東)	
固定型(株式、債券))			
		エマージング	
資産複合			
()			
資産配分固定型			
資産配分変更型			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券を対象を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。

「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

日本

目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド

目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

ファンドの特色

1. ミリオンには2つのポートフォリオがあり、皆様のニーズにあったポートフォリオをお選びいただけます。

「インデックスポートフォリオ」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざします。

「バランスポートフォリオ」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ないます。また残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。

市況の急激な変化が生じたときなど、やむを得ない事情が発生した場合ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

*TOPIX(東証株価指数)は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄(算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。)の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

2. お買付けは、原則として給与天引きです。

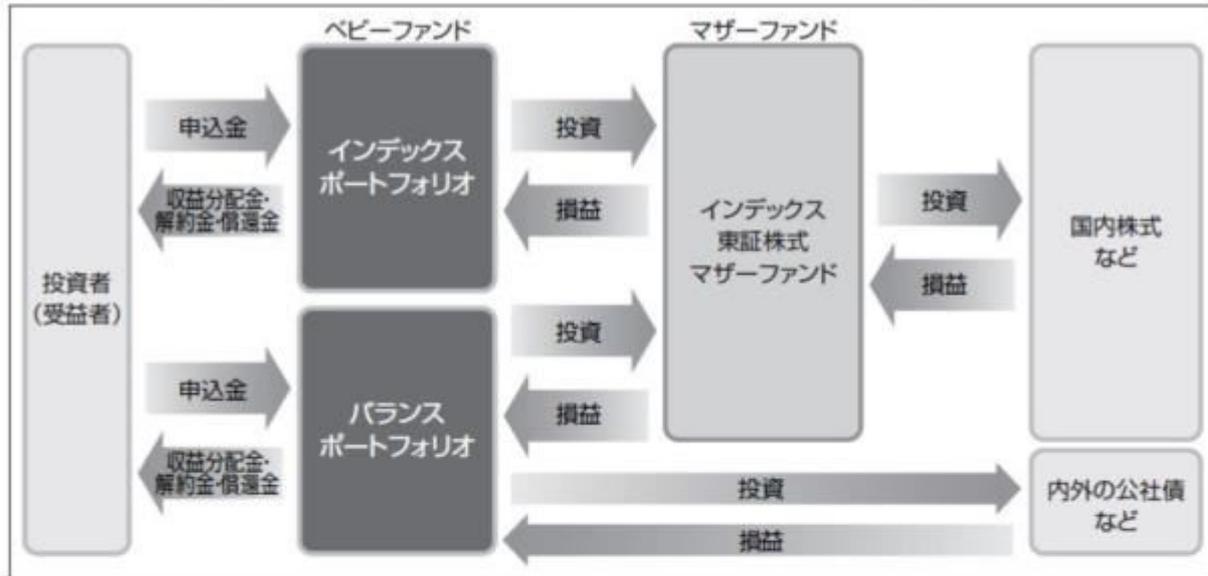
3. お買付けは、無手数料です。

4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。

ドル・コスト平均法とは、一定の金額を継続して投資する方法で、価格が安いときは多くの口数を、高いときは少ない口数を買い付けることによって、一定量(口数)ずつ買い付けた場合に比べて、平均買付コストを低く抑えることが期待できます。長期にわたり定期的に継続して積み立てることにより、ドル・コスト平均法が活かされます。

ファンドの仕組み

※当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



(主な投資制限)

「インデックスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合には制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資は行ないません。

「バランスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- ・外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

(分配方針)

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

- ・毎決算時に、利子・配当等収益を中心に安定的に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
- ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

- ・各ポートフォリオ毎に、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

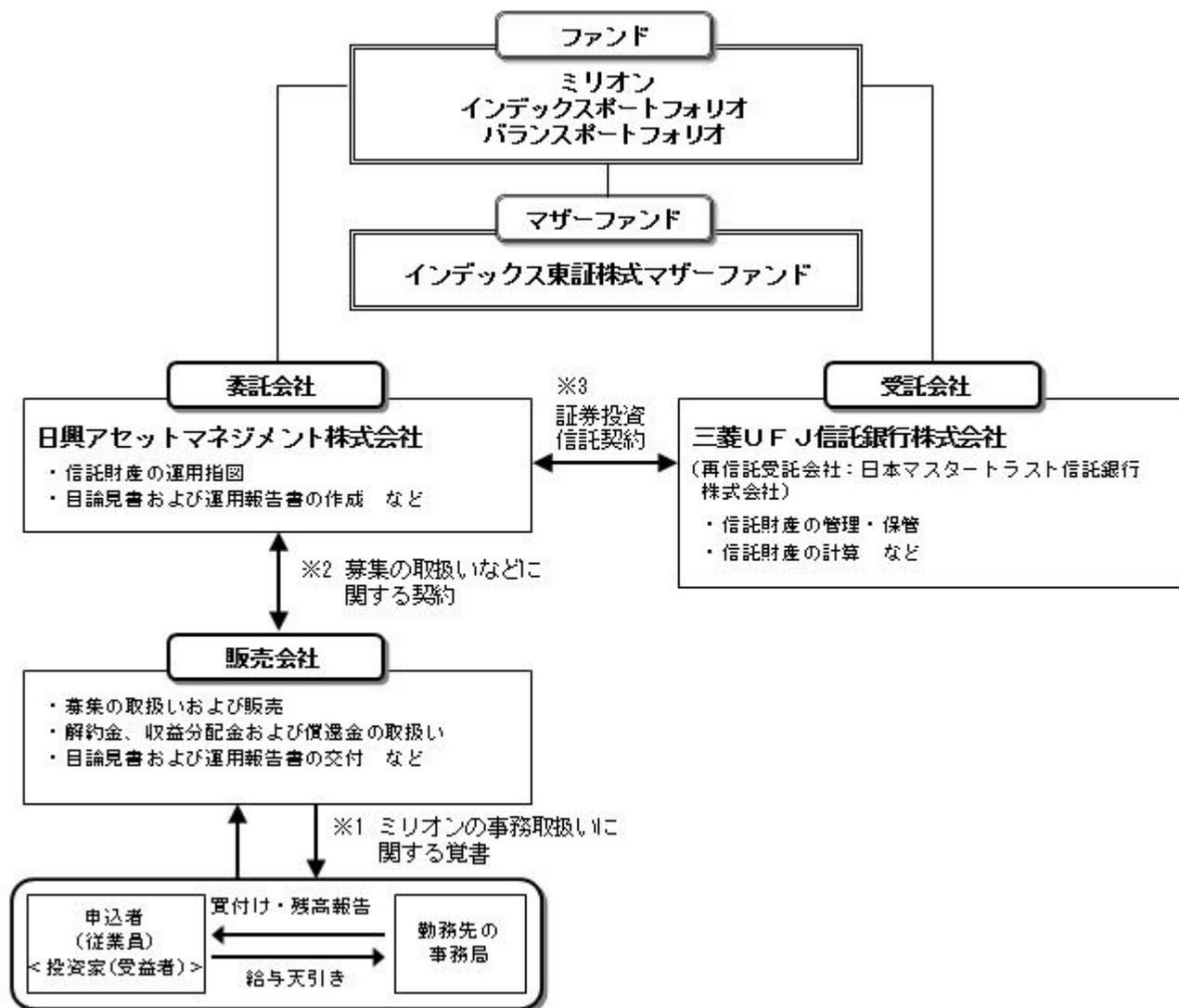
(2) 【ファンドの沿革】

1987年11月27日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 ミリオンの事務局と販売会社の間における、ミリオンのお申込み・入金・換金などに関する手続きを規定しています。
- 2 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2019年11月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2 【投資方針】

（１）【投資方針】

<インデックスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

<バランスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。
- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資することにより売買益を追求し、内外の公社債に投資することにより利息等収益の確保につとめます。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の75%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

<インデックスポートフォリオ>

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 4) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 資金の借入

<バランスポートフォリオ>

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第17条の2に定めるものに限り。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
 - 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限り。)
 - 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
 - 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。)
 - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付
 - 4) 外国為替予約取引
 - 5) 資金の借入
- <インデックス東証株式マザーファンド>
- 東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第13条の2および第13条の4に定めるものに限り。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形

主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要

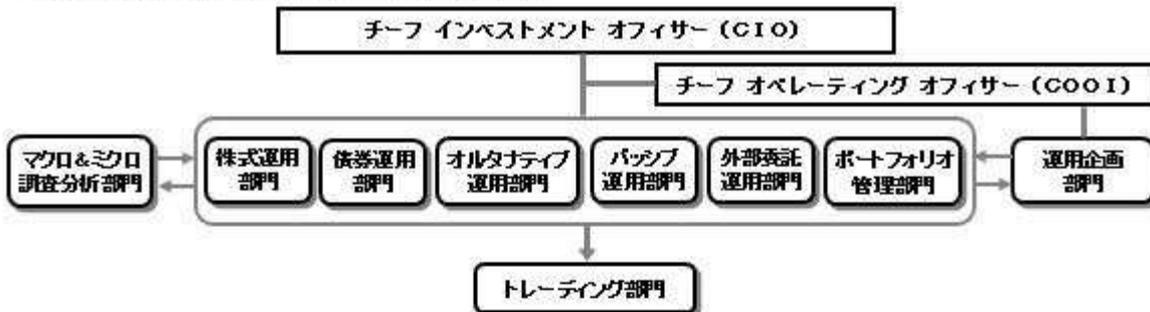
<インデックス東証株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資成果をTOPIX(東証株価指数)の動きにできるだけ連動させるため、パラー日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行いません。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行いません。 ・株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

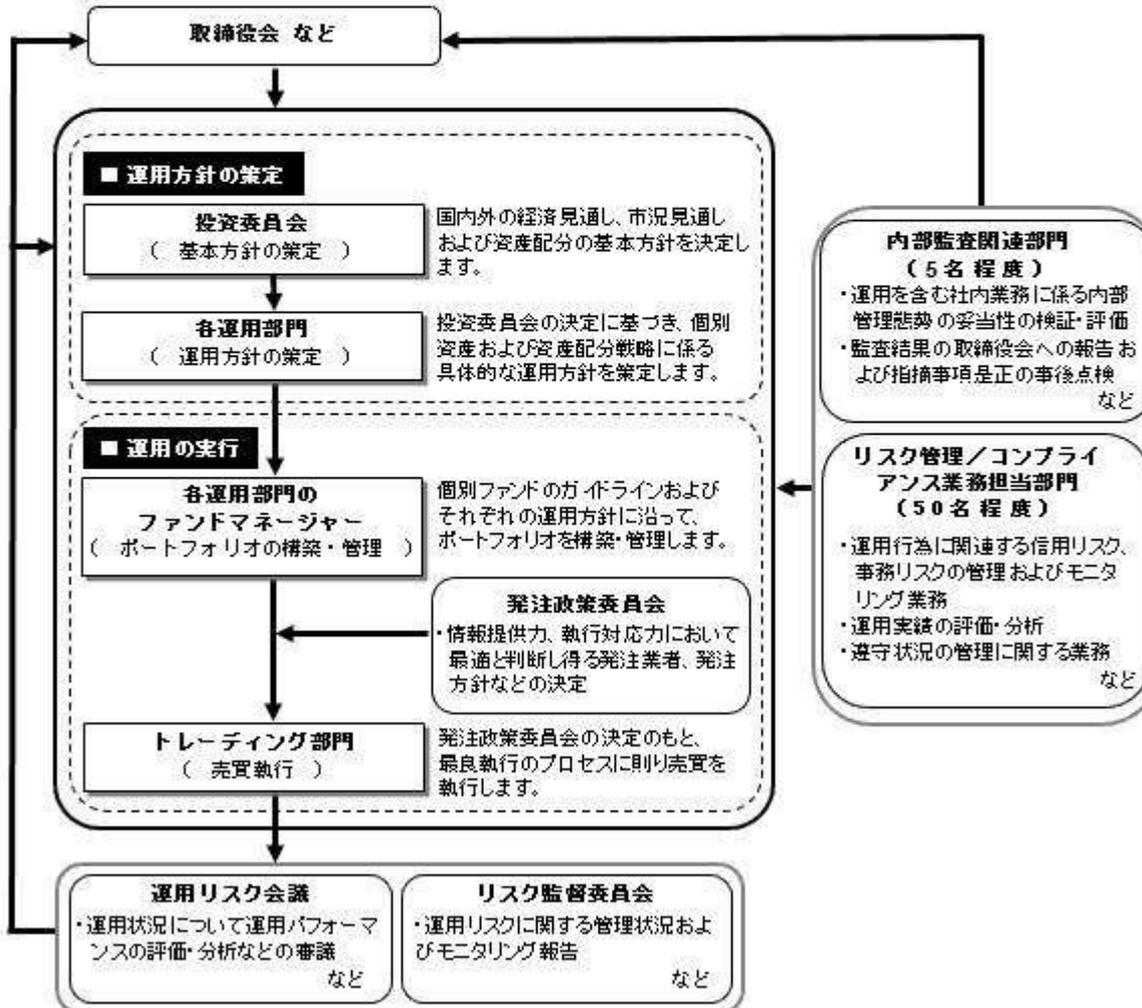
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には制限を設けません ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限(1986年10月22日設定)
決算日	毎年10月21日(休業日の場合は翌営業日)

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は2019年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用

を行ないます。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。
 - 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
 - 3) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。
- 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<バランスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額

の範囲内とします。

- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範

圏内

ロ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

ハ）借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

二）解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<インデックス東証株式マザーファンド>

1) 株式への投資割合には制限を設けません。

2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

3) 外貨建資産への投資は行ないません。

4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の

5%を上回らない範囲内とします。

- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 8) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 9) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

<インデックスポートフォリオ>

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は

下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

当ファンドは、基準価額の変動率を T O P I X（東証株価指数）の変動率に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

- ・ T O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
- ・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。
- ・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きと T O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

< バランスポートフォリオ >

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じ

た場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

< その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

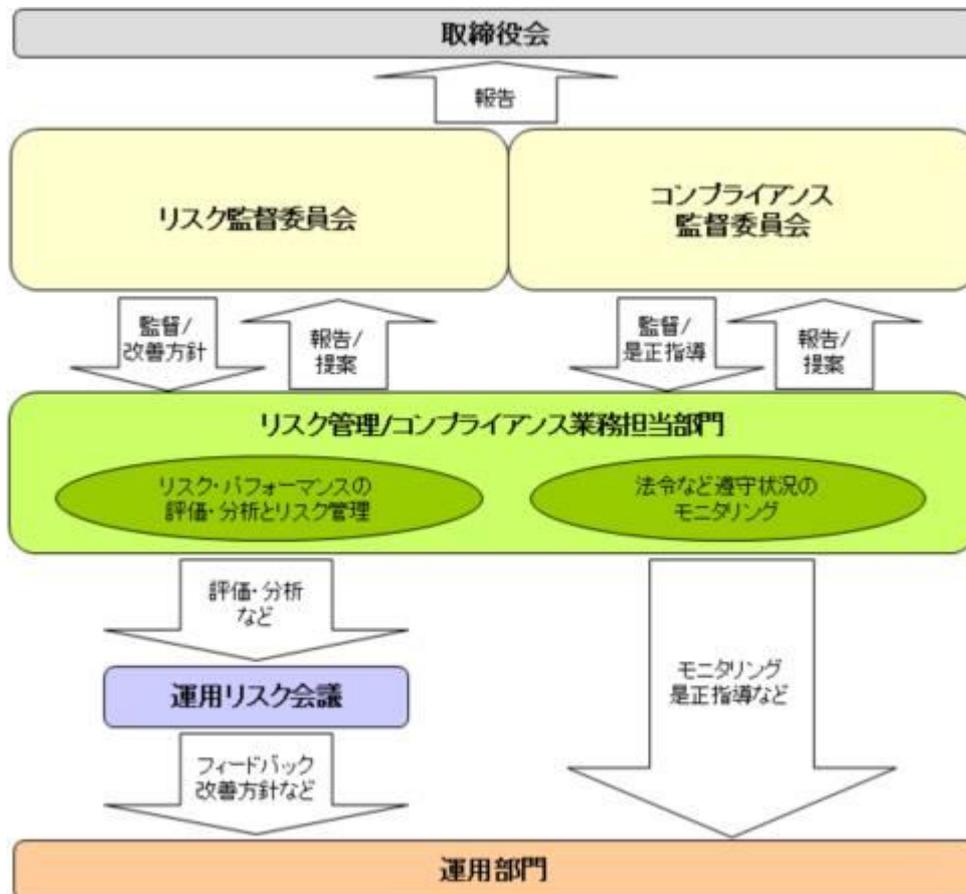
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額が乖離する可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

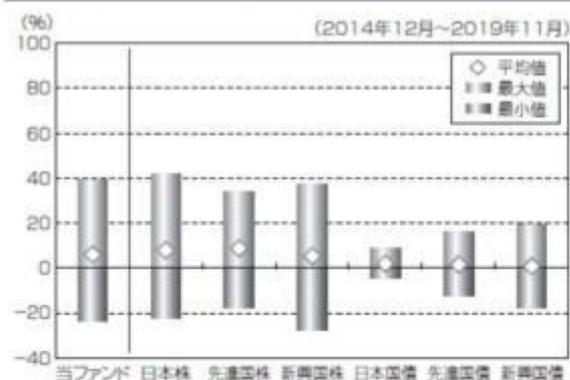
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2019年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

インデックスポートフォリオ

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))

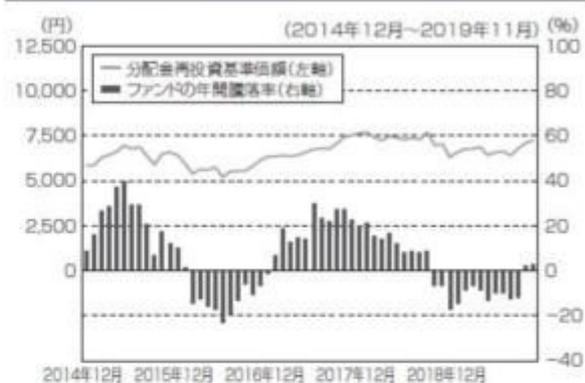
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.3%	8.1%	9.0%	5.5%	2.1%	1.8%	1.0%
最大値	39.4%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	16.4%	19.3%
最小値	-23.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2014年12月から2019年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



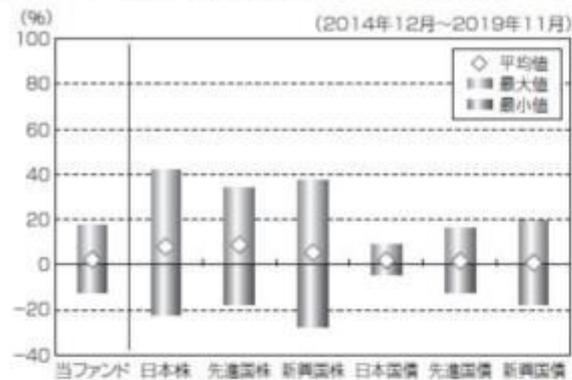
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2014年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

バランスポートフォリオ

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	2.5%	8.1%	9.0%	5.5%	2.1%	1.8%	1.0%
最大値	17.8%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	16.4%	19.3%
最小値	-12.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2014年12月から2019年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルレティバシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

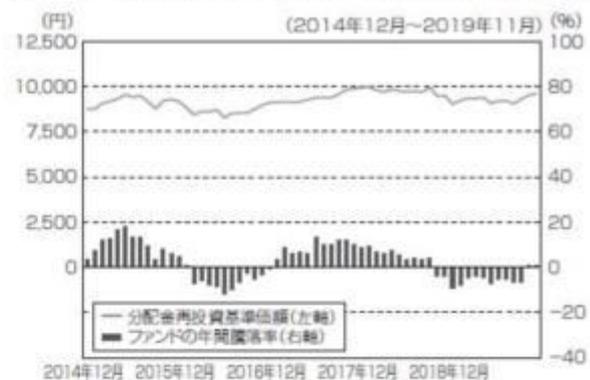
MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2014年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

負いません。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.672%（税抜1.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.52%	0.34%	1.10%	0.08%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（4）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用（「バランスポートフォリオ」のみ）、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

- ・組入る有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）^{*}については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

* 解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

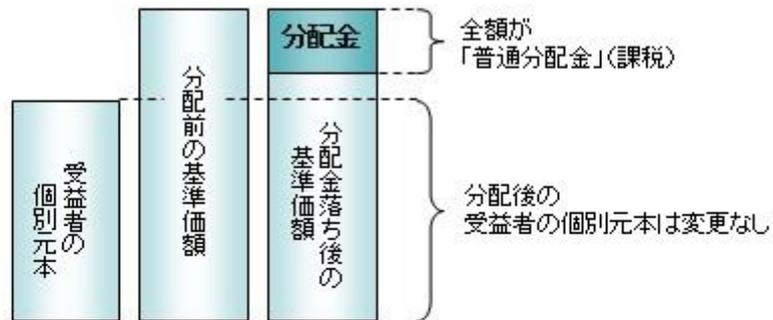
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から

元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

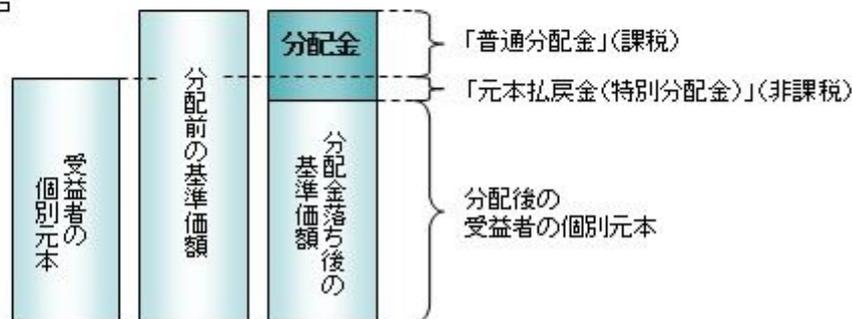
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020年2月7日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスポートフォリオ】

以下の運用状況は2019年11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,014,103,596	99.90
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		10,077,103	0.10
合計(純資産総額)		10,024,180,699	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	5,742,031,879	1.7430	10,008,362,177	1.7440	10,014,103,596	99.90

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第23計算期間末 (2010年11月 8日)	8,949	8,962	0.3442	0.3447
第24計算期間末 (2011年11月 7日)	7,970	7,983	0.3088	0.3093
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	7,945	7,958	0.3085	0.3090
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	11,931	11,943	0.4906	0.4911
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	12,764	12,776	0.5660	0.5665
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	12,726	12,735	0.6615	0.6620
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	10,507	10,516	0.5690	0.5695
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	12,193	12,201	0.7599	0.7604
第31計算期間末 (2018年11月 7日)	10,188	10,195	0.6952	0.6957
第32計算期間末 (2019年11月 7日)	10,181	10,188	0.7201	0.7206
2018年11月末日	10,241		0.7008	
12月末日	9,152		0.6287	
2019年 1月末日	9,572		0.6582	
2月末日	9,768		0.6746	
3月末日	9,698		0.6741	
4月末日	9,823		0.6845	
5月末日	9,166		0.6393	
6月末日	9,390		0.6559	

7月末日	9,440		0.6608
8月末日	9,093		0.6375
9月末日	9,600		0.6751
10月末日	10,022		0.7076
11月末日	10,024		0.7198

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	3.09
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	10.14
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.06
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	59.19
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	15.47
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	16.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	13.91
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	33.64
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	8.45
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	3.65

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
---	----	---------	---------

第23期	2009年11月10日～2010年11月8日	1,177,644,536	908,226,822
第24期	2010年11月9日～2011年11月7日	1,083,821,347	1,275,668,411
第25期	2011年11月8日～2012年11月7日	1,098,402,396	1,156,956,048
第26期	2012年11月8日～2013年11月7日	726,814,196	2,160,223,460
第27期	2013年11月8日～2014年11月7日	540,447,887	2,308,575,579
第28期	2014年11月8日～2015年11月9日	397,656,514	3,710,414,810
第29期	2015年11月10日～2016年11月7日	404,194,947	1,174,901,250
第30期	2016年11月8日～2017年11月7日	324,013,392	2,744,057,822
第31期	2017年11月8日～2018年11月7日	240,808,421	1,634,396,234
第32期	2018年11月8日～2019年11月7日	252,391,538	768,201,863

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2019年11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	20,004,952	9.25
地方債証券	日本	33,806,580	15.63
親投資信託受益証券	日本	107,923,177	49.89
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		54,608,948	25.24
合計(純資産総額)		216,343,657	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	インデックス東証 株式マザーファン ド	61,882,556	1.7430	107,861,296	1.7440	107,923,177			49.89
日本	国債証券	第122回利付国 債(5年)	20,000,000	100.02	20,004,952	100.02	20,004,952	0.100	2019/12/20	9.25
日本	地方債証券	平成24年度第1 0回静岡県公 債	18,000,000	102.26	18,408,240	102.23	18,401,580	0.678	2023/3/22	8.51
日本	地方債証券	第401回大阪府 公債(10 年)	15,000,000	102.82	15,423,000	102.70	15,405,000	0.477	2025/10/29	7.12

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	9.25
地方債証券	15.63
親投資信託受益証券	49.89
合 計	74.76

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第23計算期間末 (2010年11月 8日)	424	424	0.6749	0.6754
第24計算期間末 (2011年11月 7日)	381	381	0.6403	0.6408
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	366	366	0.6377	0.6382
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	436	437	0.8067	0.8072
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	382	382	0.8619	0.8624
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	322	322	0.9300	0.9305
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	271	271	0.8629	0.8634
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	268	268	0.9920	0.9925
第31計算期間末 (2018年11月 7日)	218	218	0.9443	0.9448
第32計算期間末 (2019年11月 7日)	217	217	0.9565	0.9570
2018年11月末日	218		0.9476	
12月末日	204		0.8988	
2019年 1月末日	207		0.9194	
2月末日	207		0.9306	
3月末日	207		0.9298	
4月末日	209		0.9364	
5月末日	203		0.9045	
6月末日	205		0.9154	
7月末日	207		0.9180	
8月末日	203		0.9013	
9月末日	209		0.9265	
10月末日	215		0.9483	
11月末日	216		0.9559	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	1.89
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	5.05
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.33
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	26.58
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	6.90
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	7.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	7.16
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	15.02
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	4.76
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	1.34

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	26,059,079	33,889,327
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	24,624,836	57,559,266
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	21,493,518	42,290,225
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	14,701,201	47,759,106
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	11,634,468	109,900,290
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	9,591,772	106,409,569

第29期	2015年11月10日～2016年11月7日	9,326,069	41,548,116
第30期	2016年11月8日～2017年11月7日	7,480,324	50,984,226
第31期	2017年11月8日～2018年11月7日	6,405,223	46,051,030
第32期	2018年11月8日～2019年11月7日	6,506,949	10,601,618

(参考)

インデックス東証株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年11月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	10,003,365,930	98.81
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		120,853,543	1.19
合計(純資産総額)		10,124,219,473	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	84,850,000	0.84

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	46,500	7,401.65	344,176,725	7,638.00	355,167,000	3.51
日本	株式	ソニー	電気機器	26,400	6,460.00	170,544,000	6,904.00	182,265,600	1.80
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	283,100	555.53	157,270,543	578.10	163,660,110	1.62
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	34,700	3,797.00	131,755,900	4,455.00	154,588,500	1.53
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	27,400	5,329.00	146,014,600	5,527.00	151,439,800	1.50
日本	株式	キーエンス	電気機器	3,800	33,440.00	127,072,000	37,440.00	142,272,000	1.41
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	32,500	4,295.65	139,608,625	4,253.00	138,222,500	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	28,400	3,759.00	106,755,600	3,989.00	113,287,600	1.12
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	28,500	3,532.78	100,684,230	3,962.00	112,917,000	1.12

日本	株式	任天堂	その他製品	2,600	38,546.15	100,220,000	42,350.00	110,110,000	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	32,800	2,895.00	94,956,000	3,067.00	100,597,600	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	30,500	2,982.50	90,966,250	3,139.00	95,739,500	0.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	558,900	165.35	92,414,115	169.20	94,565,880	0.93
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	30,200	2,877.65	86,905,030	3,003.00	90,690,600	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	14,700	5,731.77	84,257,019	5,952.00	87,494,400	0.86
日本	株式	花王	化学	10,000	8,292.43	82,924,300	8,612.00	86,120,000	0.85
日本	株式	日立製作所	電気機器	20,000	4,140.52	82,810,400	4,300.00	86,000,000	0.85
日本	株式	HOYA	精密機器	8,400	9,182.48	77,132,832	9,990.00	83,916,000	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	4,000	20,925.00	83,700,000	20,905.00	83,620,000	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	5,300	14,720.00	78,016,000	15,745.00	83,448,500	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	28,800	2,703.90	77,872,320	2,866.00	82,540,800	0.82
日本	株式	信越化学工業	化学	7,000	12,007.57	84,052,990	11,710.00	81,970,000	0.81
日本	株式	第一三共	医薬品	11,900	6,635.86	78,966,734	6,862.00	81,657,800	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	5,000	15,185.96	75,929,800	16,190.00	80,950,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,200	5,837.00	71,211,400	6,344.00	77,396,800	0.76
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	3,500	22,590.00	79,065,000	22,095.00	77,332,500	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	7,300	10,000.00	73,000,000	10,070.00	73,511,000	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	36,200	1,795.73	65,005,426	1,939.50	70,209,900	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	36,700	1,710.30	62,768,010	1,867.50	68,537,250	0.68
日本	株式	キヤノン	電気機器	22,400	2,914.77	65,290,848	3,030.00	67,872,000	0.67

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.75
		食料品	3.87
		繊維製品	0.58
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.06
		医薬品	5.94
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.58
		機械	5.06
		電気機器	14.05
輸送用機器	7.74		
精密機器	2.32		

	その他製品	2.31
	電気・ガス業	1.53
	陸運業	4.51
	海運業	0.17
	空運業	0.51
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.45
	卸売業	4.90
	小売業	4.57
	銀行業	5.79
	証券、商品先物取引業	0.83
	保険業	2.27
	その他金融業	1.16
	不動産業	2.38
	サービス業	5.08
合 計		98.81

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2019年12月	買建	5	日本円	82,486,100	84,850,000	0.84

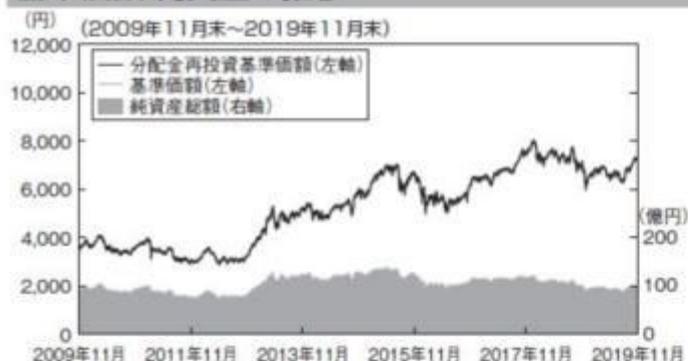
(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

参考情報

運用実績(インデックスポートフォリオ)

2019年11月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額7,198円

純資産総額 100.24億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2009年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもとのとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2015年11月	2016年11月	2017年11月	2018年11月	2019年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	160円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	98.73%
株式先物	0.84%
債券	—
債券先物	—
現金その他	1.27%

※当ファンドの実質組入比率です。

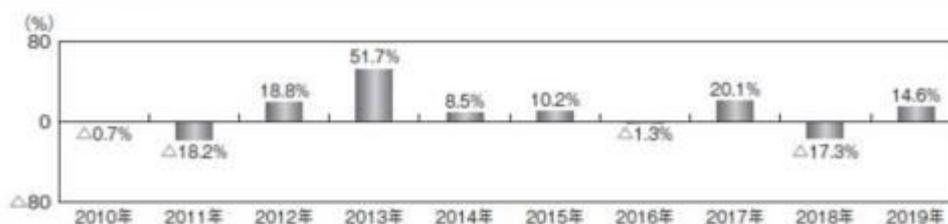
<組入上位10銘柄>

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.51%
2 ソニー	電気機器	1.80%
3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.62%
4 武田薬品工業	医薬品	1.53%
5 日本電信電話	情報・通信業	1.50%
6 キーエンス	電気機器	1.41%
7 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.37%
8 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.12%
9 リクルートホールディングス	サービス業	1.12%
10 任天堂	その他製品	1.09%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したもとのとして計算しております。

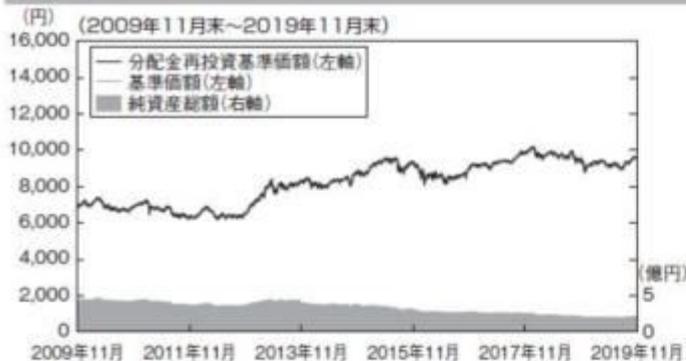
※2019年は、2019年11月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用実績(バランスポートフォリオ)

2019年11月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額9,559円
純資産総額 2.16億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2009年11月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもとのとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2015年11月	2016年11月	2017年11月	2018年11月	2019年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	160円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	49.30%
株式先物	0.42%
債券	24.87%
債券先物	0.00%
現金その他	25.83%

※当ファンドの実質組入比率です。

<組入上位銘柄>

当ファンド

銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1 インデックス東証株式マザーファンド	権投資信託受益証券	—	—	49.89%
2 第122回利付国債(5年)	国債証券	0.100%	2019年12月20日	9.25%
3 平成24年度第10回静岡県公募債	地方債証券	0.678%	2023年3月22日	8.51%
4 第401回大阪府公募債(10年)	地方債証券	0.477%	2025年10月29日	7.12%

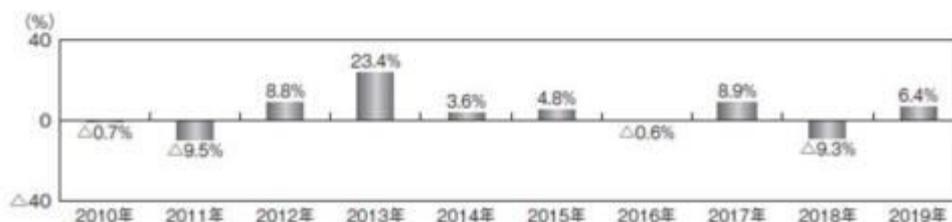
※当ファンドの対純資産総額比です。

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.51%
2 ソニー	電気機器	1.80%
3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.62%
4 武田薬品工業	医薬品	1.53%
5 日本電信電話	情報・通信業	1.50%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したもとのとして計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2019年は、2019年11月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

- ・原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

(2) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(3) 申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

(4) 申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

(5) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

(2) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(3) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(7) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

< 買取請求による換金 >

(1) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

(2) 買取制限

ファンドの規模および商品性格などにに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の買取りには受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(3) 買取価額

買取請求受付日の基準価額から、当該買取りを行なう販売会社に係る源泉徴収税額に相当する金額を控除した価額となります。なお、一定の要件の下では、買取請求受付日の基準価額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(5) 買取単位

1口単位

販売会社によっては、買取単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 受付の中止および取消

- ・販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
- ・買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

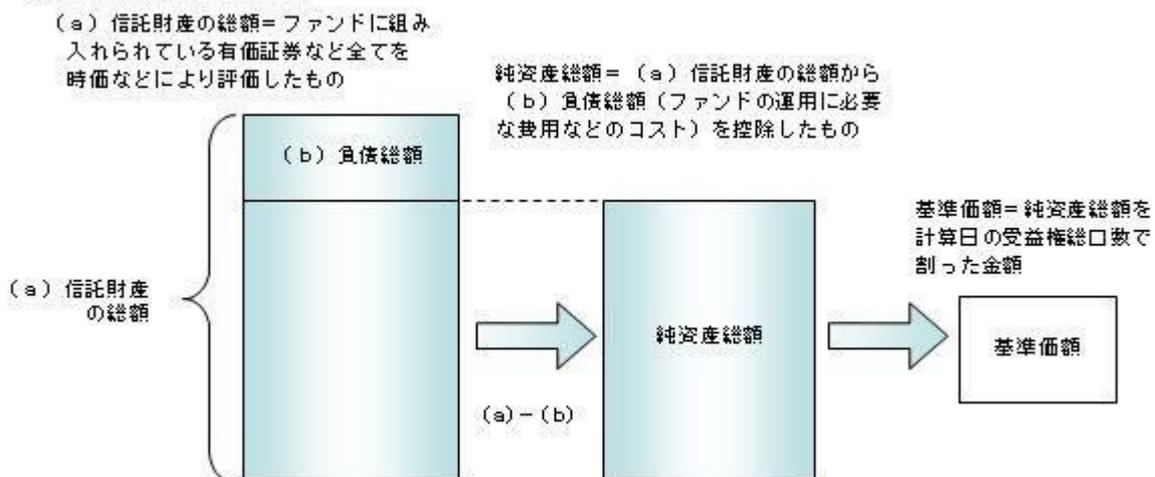
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

< 主な資産の評価方法 >

インデックスポートフォリオ	マザーファンド受益証券 基準価額計算日の基準価額で評価します。 国内上場株式 原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
バランスポートフォリオ	マザーファンド受益証券 基準価額計算日の基準価額で評価します。 国内上場株式 原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。 公社債（国内・外国） 原則として、基準価額計算日 [*] における以下のいずれかの価額で評価します。 a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。） c) 価格情報会社の提供する価額 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。 [*] 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（1987年11月27日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年11月8日から翌年11月7日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - <インデックスポートフォリオ>
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) 対象インデックスが改廃の場合
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
 - <バランスポートフォリオ>
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

 - ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日まで)から受益者に支払います。
 - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

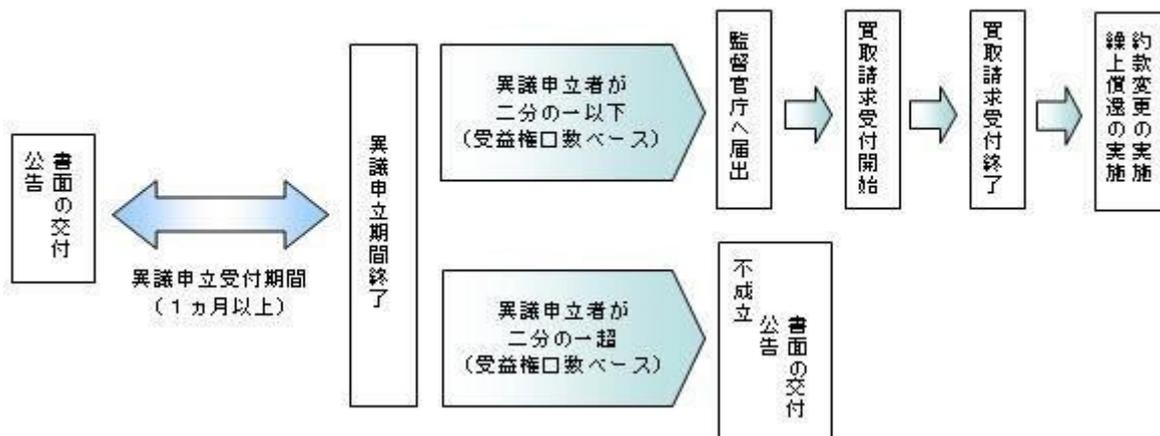
信託約款の変更

 - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
 - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

 - 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
 - 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

(3) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

<インデックスポートフォリオ>

<バランスポートフォリオ>

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期計算期間（2018年11月 8日から2019年11月 7日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第31期 2018年11月 7日現在	第32期 2019年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	100,074,052	88,063,328
親投資信託受益証券	10,185,813,987	10,191,277,391
未収入金	9,717,885	4,688,446
流動資産合計	10,295,605,924	10,284,029,165
資産合計	10,295,605,924	10,284,029,165
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,327,034	7,069,129
未払解約金	9,761,091	17,047,199
未払受託者報酬	4,741,028	4,127,759
未払委託者報酬	85,339,716	74,300,830
未払利息	173	56
その他未払費用	290,325	206,330
流動負債合計	107,459,367	102,751,303
負債合計	107,459,367	102,751,303
純資産の部		
元本等		
元本	14,654,068,810	14,138,258,485
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,465,922,253	3,956,980,623
(分配準備積立金)	2,653,678,342	2,508,680,347
元本等合計	10,188,146,557	10,181,277,862
純資産合計	10,188,146,557	10,181,277,862
負債純資産合計	10,295,605,924	10,284,029,165

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第31期		第32期	
	自 2017年11月 8日	至 2018年11月 7日	自 2018年11月 8日	至 2019年11月 7日
営業収益				
受取利息		546		301
有価証券売買等損益		764,359,107		505,843,198
営業収益合計		764,358,561		505,843,499
営業費用				
支払利息		27,642		17,285
受託者報酬		9,651,247		8,286,551
委託者報酬		173,724,741		149,160,125
その他費用		593,021		417,100
営業費用合計		183,996,651		157,881,061
営業利益又は営業損失()		948,355,212		347,962,438
経常利益又は経常損失()		948,355,212		347,962,438
当期純利益又は当期純損失()		948,355,212		347,962,438
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		14,366,989		18,808,954
期首剰余金又は期首欠損金()		3,853,731,505		4,465,922,253
剰余金増加額又は欠損金減少額		392,638,863		234,332,430
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		392,638,863		234,332,430
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		63,514,354		85,093,063
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		63,514,354		85,093,063
分配金		7,327,034		7,069,129
期末剰余金又は期末欠損金()		4,465,922,253		3,956,980,623

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		第31期 2018年11月 7日現在	第32期 2019年11月 7日現在
1.	期首元本額	16,047,656,623円	14,654,068,810円
	期中追加設定元本額	240,808,421円	252,391,538円
	期中一部解約元本額	1,634,396,234円	768,201,863円
2.	受益権の総数	14,654,068,810口	14,138,258,485口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	4,465,922,253円	3,956,980,623円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第31期 自 2017年11月 8日 至 2018年11月 7日		第32期 自 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	1,819,751,376円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	2,661,005,376円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,480,756,752円	E 分配対象収益(A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,057円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	7,327,034円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第31期 自 2017年11月 8日 至 2018年11月 7日	第32期 自 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日

金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第31期 2018年11月 7日現在	第32期 2019年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第31期(2018年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	652,778,890
合計	652,778,890

第32期(2019年11月7日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	637,320,272
合計	637,320,272

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第31期 2018年11月7日現在		第32期 2019年11月7日現在	
1口当たり純資産額	0.6952円	1口当たり純資産額	0.7201円
(1万口当たり純資産額)	(6,952円)	(1万口当たり純資産額)	(7,201円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	5,846,974,981	10,191,277,391	
合計		5,846,974,981	10,191,277,391	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【バランスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第31期 2018年11月 7日現在	第32期 2019年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,015,057	52,952,066
国債証券	20,054,600	20,008,076
地方債証券	32,974,520	33,831,240
親投資信託受益証券	109,352,023	112,314,192
未収利息	16,352	24,688
流動資産合計	220,412,552	219,130,262
資産合計		
220,412,552		
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	115,636	113,589
未払受託者報酬	99,641	90,572
未払委託者報酬	1,794,596	1,631,418
未払利息	100	33
その他未払費用	6,043	4,471
流動負債合計	2,016,016	1,840,083
負債合計		
2,016,016		
純資産の部		
元本等		
元本	231,272,903	227,178,234
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	12,876,367	9,888,055
(分配準備積立金)	28,287,654	26,939,487
元本等合計	218,396,536	217,290,179
純資産合計		
218,396,536		
負債純資産合計		
220,412,552		
219,130,262		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第31期		第32期	
	自 至	2017年11月 8日 2018年11月 7日	自 至	2018年11月 8日 2019年11月 7日
営業収益				
受取利息		245,872		138,792
有価証券売買等損益		7,237,358		6,056,360
営業収益合計		6,991,486		6,195,152
営業費用				
支払利息		27,212		21,264
受託者報酬		205,391		180,260
委託者報酬		3,699,199		3,246,826
その他費用		15,560		11,826
営業費用合計		3,947,362		3,460,176
営業利益又は営業損失()		10,938,848		2,734,976
経常利益又は経常損失()		10,938,848		2,734,976
当期純利益又は当期純損失()		10,938,848		2,734,976
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		125,060		284,096
期首剰余金又は期首欠損金()		2,158,863		12,876,367
剰余金増加額又は欠損金減少額		370,695		591,144
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		370,695		591,144
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		158,775		508,315
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		158,775		508,315
分配金		115,636		113,589
期末剰余金又は期末欠損金()		12,876,367		9,888,055

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び地方債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		第31期 2018年11月7日現在	第32期 2019年11月7日現在
1.	期首元本額	270,918,710円	231,272,903円
	期中追加設定元本額	6,405,223円	6,506,949円
	期中一部解約元本額	46,051,030円	10,601,618円
2.	受益権の総数	231,272,903口	227,178,234口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	12,876,367円	9,888,055円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第31期 自 2017年11月8日 至 2018年11月7日		第32期 自 2018年11月8日 至 2019年11月7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 54,940円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	33,510,573円	C 信託約款に定める収益調整金 33,705,960円

D 信託約款に定める分配準備積立金	28,403,290円	D 信託約款に定める分配準備積立金	26,998,136円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	61,913,863円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	60,759,036円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,677円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,674円
G 分配金額	115,636円	G 分配金額	113,589円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第31期 自 2017年11月 8日 至 2018年11月 7日	第32期 自 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第31期 2018年11月 7日現在	第32期 2019年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第31期(2018年11月7日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	64,000
地方債証券	12,440
親投資信託受益証券	7,478,262
合計	7,529,822

第32期(2019年11月7日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	46,524
地方債証券	41,940
親投資信託受益証券	6,572,602
合計	6,484,138

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第31期 2018年11月 7日現在		第32期 2019年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.9443円	1口当たり純資産額	0.9565円
(1万口当たり純資産額)	(9,443円)	(1万口当たり純資産額)	(9,565円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第122回利付国債(5年)	20,000,000	20,008,076	
国債証券 合計		20,000,000	20,008,076	
地方債証券	第401回大阪府公募公債(10年)	15,000,000	15,423,000	
	平成24年度第10回静岡県公募公債	18,000,000	18,408,240	
地方債証券 合計		33,000,000	33,831,240	
親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	64,437,288	112,314,192	
親投資信託受益証券 合計		64,437,288	112,314,192	
合計		117,437,288	166,153,508	

(注)親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」は、「インデックス東証株式マザーファン

ド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	2018年11月 7日現在	2019年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	154,827	331,881
コール・ローン	135,169,863	71,013,131
株式	10,077,500,940	10,141,204,820
派生商品評価勘定	1,318,380	7,386,210
未収入金	-	1,788,910
未収配当金	93,672,074	95,923,382
前払金	10,305,000	-
流動資産合計	10,318,121,084	10,317,648,334
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,594,320	-
前受金	-	8,695,000
未払金	1,061,080	-
未払解約金	9,717,885	4,688,446
未払利息	234	45
流動負債合計	22,373,519	13,383,491
純資産の部		
元本等		
元本	6,224,405,085	5,911,412,269
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,071,342,480	4,392,852,574
元本等合計	10,295,747,565	10,304,264,843
純資産合計	10,295,747,565	10,304,264,843
負債純資産合計	10,318,121,084	10,317,648,334

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p>
--------------------	---

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2018年11月 7日現在	2019年11月 7日現在
1.	期首	2017年11月 8日	2018年11月 8日
	期首元本額	6,948,269,687円	6,224,405,085円
	期首からの追加設定元本額	43,119,745円	54,893,709円
	期首からの一部解約元本額	766,984,347円	367,886,525円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	6,158,291,407円	5,846,974,981円
	バランスポートフォリオ	66,113,678円	64,437,288円
	計	6,224,405,085円	5,911,412,269円
2.	受益権の総数	6,224,405,085口	5,911,412,269口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	97,331,050円	70,487,060円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2017年11月 8日 至 2018年11月 7日	自 2018年11月 8日 至 2019年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	2018年11月 7日現在	2019年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2018年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	253,972,870
合計	253,972,870

(2019年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	412,314,790
合計	412,314,790

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2018年11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	192,430,000	-	182,160,000	10,270,000
合計		192,430,000	-	182,160,000	10,270,000

(2019年11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	111,890,000	-	119,280,000	7,390,000
合計		111,890,000	-	119,280,000	7,390,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年11月 7日現在		2019年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.654円	1口当たり純資産額	1.743円
(1千口当たり純資産額)	(1,654円)	(1千口当たり純資産額)	(1,743円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	200	2,984.00	596,800	
日本水産	5,700	641.00	3,653,700	
マルハニチロ	800	2,945.00	2,356,000	
カネコ種苗	200	1,500.00	300,000	
サカタのタネ	700	3,605.00	2,523,500	
ホクト	400	1,932.00	772,800	
ホクリヨウ	100	709.00	70,900	
住石ホールディングス	1,100	140.00	154,000	
日鉄鉱業	100	4,770.00	477,000	
三井松島ホールディングス	200	1,313.00	262,600	
国際石油開発帝石	23,100	1,066.00	24,624,600	
石油資源開発	800	2,883.00	2,306,400	
K & O エナジーグループ	300	1,664.00	499,200	
ヒノキヤグループ	100	2,126.00	212,600	
ショーボンドホールディングス	800	4,260.00	3,408,000	
ミライト・ホールディングス	1,700	1,752.00	2,978,400	
タマホーム	300	1,972.00	591,600	
サンヨーホームズ	100	713.00	71,300	
日本アクア	200	692.00	138,400	
ファーストコーポレーション	200	718.00	143,600	
ベステラ	100	1,233.00	123,300	
スペースバリューホールディングス	700	525.00	367,500	
ダイセキ環境ソリューション	100	951.00	95,100	
第一カッター興業	100	1,862.00	186,200	
安藤・間	3,400	858.00	2,917,200	
東急建設	1,700	851.00	1,446,700	
コムシスホールディングス	2,000	3,140.00	6,280,000	
ミサワホーム	400	1,195.00	478,000	
ピーアールホールディングス	600	455.00	273,000	

高松コンストラクショングループ	400	2,702.00	1,080,800
東建コーポレーション	200	7,190.00	1,438,000
ソネック	100	839.00	83,900
ヤマウラ	300	879.00	263,700
大成建設	4,400	4,435.00	19,514,000
大林組	13,300	1,142.00	15,188,600
清水建設	13,500	1,043.00	14,080,500
飛島建設	400	1,422.00	568,800
長谷工コーポレーション	5,100	1,430.00	7,293,000
松井建設	500	885.00	442,500
銭高組	100	4,205.00	420,500
鹿島建設	10,400	1,526.00	15,870,400
不動テトラ	300	1,486.00	445,800
大末建設	200	974.00	194,800
鉄建建設	300	2,907.00	872,100
西松建設	1,000	2,348.00	2,348,000
三井住友建設	3,200	623.00	1,993,600
大豊建設	300	3,050.00	915,000
前田建設工業	3,300	1,048.00	3,458,400
佐田建設	300	417.00	125,100
ナカノフドー建設	400	508.00	203,200
奥村組	700	3,180.00	2,226,000
東鉄工業	600	3,370.00	2,022,000
イチケン	100	1,760.00	176,000
富士ピー・エス	200	629.00	125,800
浅沼組	100	4,205.00	420,500
戸田建設	5,500	700.00	3,850,000
熊谷組	600	3,370.00	2,022,000
北野建設	100	2,939.00	293,900
植木組	100	2,556.00	255,600
矢作建設工業	600	769.00	461,400
ピーエス三菱	400	776.00	310,400
日本ハウスホールディングス	900	512.00	460,800
大東建託	1,600	14,250.00	22,800,000
新日本建設	600	887.00	532,200
N I P P O	1,100	2,219.00	2,440,900
東亜道路工業	100	3,390.00	339,000
前田道路	1,400	2,403.00	3,364,200
日本道路	100	6,580.00	658,000
東亜建設工業	400	1,565.00	626,000
日本国土開発	800	657.00	525,600
若築建設	200	1,667.00	333,400

東洋建設	1,500	521.00	781,500
五洋建設	5,300	674.00	3,572,200
世紀東急工業	600	813.00	487,800
福田組	200	4,680.00	936,000
住友林業	3,400	1,570.00	5,338,000
日本基礎技術	400	392.00	156,800
巴コーポレーション	600	424.00	254,400
大和ハウス工業	13,100	3,758.00	49,229,800
ライト工業	800	1,695.00	1,356,000
積水ハウス	14,500	2,356.00	34,162,000
日特建設	400	723.00	289,200
北陸電気工事	200	1,060.00	212,000
ユアテック	800	707.00	565,600
四電工	100	2,765.00	276,500
中電工	500	2,549.00	1,274,500
関電工	1,900	1,035.00	1,966,500
きんでん	3,100	1,645.00	5,099,500
東京エネシス	400	969.00	387,600
トーエネック	100	3,725.00	372,500
住友電設	400	2,378.00	951,200
日本電設工業	700	2,358.00	1,650,600
協和エクシオ	2,000	2,752.00	5,504,000
新日本空調	400	2,148.00	859,200
九電工	900	3,700.00	3,330,000
三機工業	1,000	1,345.00	1,345,000
日揮ホールディングス	4,100	1,604.00	6,576,400
中外炉工業	100	1,799.00	179,900
ヤマト	400	745.00	298,000
太平電業	300	2,589.00	776,700
高砂熱学工業	1,200	1,989.00	2,386,800
三晃金属工業	100	2,601.00	260,100
朝日工業社	100	3,305.00	330,500
明星工業	900	920.00	828,000
大気社	600	3,685.00	2,211,000
ダイダン	300	2,649.00	794,700
日比谷総合設備	400	2,044.00	817,600
東芝プラントシステム	1,000	2,104.00	2,104,000
OSJBホールディングス	2,100	266.00	558,600
東洋エンジニアリング	600	727.00	436,200
レイズネクスト	700	1,111.00	777,700
日本製粉	1,200	1,765.00	2,118,000
日清製粉グループ本社	4,800	2,157.00	10,353,600

昭和産業	400	3,220.00	1,288,000
鳥越製粉	400	950.00	380,000
中部飼料	500	1,342.00	671,000
フィード・ワン	2,900	177.00	513,300
東洋精糖	100	1,131.00	113,100
日本甜菜製糖	200	2,092.00	418,400
三井製糖	400	2,270.00	908,000
塩水港精糖	500	215.00	107,500
日新製糖	200	2,010.00	402,000
森永製菓	1,000	5,390.00	5,390,000
中村屋	100	4,690.00	469,000
江崎グリコ	1,300	5,140.00	6,682,000
名糖産業	200	1,306.00	261,200
井村屋グループ	200	2,166.00	433,200
不二家	200	2,153.00	430,600
山崎製パン	3,200	1,889.00	6,044,800
第一屋製パン	100	980.00	98,000
モロゾフ	100	5,060.00	506,000
亀田製菓	200	5,080.00	1,016,000
寿スピリッツ	400	7,420.00	2,968,000
カルビー	1,900	3,530.00	6,707,000
森永乳業	800	4,420.00	3,536,000
六甲バター	300	1,821.00	546,300
ヤクルト本社	2,900	6,350.00	18,415,000
明治ホールディングス	2,800	8,170.00	22,876,000
雪印メグミルク	1,000	2,605.00	2,605,000
プリマハム	700	2,609.00	1,826,300
日本ハム	1,600	4,860.00	7,776,000
林兼産業	100	670.00	67,000
丸大食品	500	2,353.00	1,176,500
S Foods	300	2,950.00	885,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,800	701.00	1,962,800
サッポロホールディングス	1,400	2,552.00	3,572,800
アサヒグループホールディングス	8,900	5,178.00	46,084,200
キリンホールディングス	18,000	2,299.00	41,382,000
宝ホールディングス	3,200	1,080.00	3,456,000
オエノンホールディングス	1,100	386.00	424,600
養命酒製造	100	1,988.00	198,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	3,000	2,551.00	7,653,000
サントリー食品インターナショナル	2,800	4,820.00	13,496,000
ダイドーグループホールディングス	200	4,375.00	875,000
伊藤園	1,300	5,330.00	6,929,000

キーコーヒー	400	2,398.00	959,200
ユニカフェ	100	1,040.00	104,000
ジャパンフーズ	100	1,222.00	122,200
日清オイリオグループ	500	4,085.00	2,042,500
不二製油グループ本社	1,000	3,185.00	3,185,000
J・オイルミルズ	200	4,530.00	906,000
キッコーマン	3,100	5,570.00	17,267,000
味の素	9,400	1,876.00	17,634,400
キューピー	2,400	2,501.00	6,002,400
ハウス食品グループ本社	1,600	4,020.00	6,432,000
カゴメ	1,600	2,655.00	4,248,000
焼津水産化学工業	200	1,056.00	211,200
アリアケジャパン	400	8,400.00	3,360,000
ピエトロ	100	1,631.00	163,100
エバラ食品工業	100	2,188.00	218,800
ニチレイ	2,000	2,579.00	5,158,000
東洋水産	2,200	4,815.00	10,593,000
イトアアンド	200	1,763.00	352,600
大冷	100	1,993.00	199,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	960.00	192,000
日清食品ホールディングス	1,800	8,570.00	15,426,000
永谷園ホールディングス	200	2,160.00	432,000
一正蒲鉾	200	1,091.00	218,200
フジッコ	500	2,003.00	1,001,500
ロック・フィールド	500	1,508.00	754,000
日本たばこ産業	24,500	2,437.00	59,706,500
ケンコーマヨネーズ	200	2,578.00	515,600
わらべや日洋ホールディングス	300	1,930.00	579,000
なとり	200	1,709.00	341,800
イフジ産業	100	753.00	75,300
ピクルスコーポレーション	100	2,551.00	255,100
北の達人コーポレーション	1,500	655.00	982,500
ユーグレナ	1,800	889.00	1,600,200
ミヨシ油脂	200	1,291.00	258,200
理研ビタミン	200	4,040.00	808,000
片倉工業	600	1,419.00	851,400
ゲンゼ	300	5,260.00	1,578,000
東洋紡	1,600	1,600.00	2,560,000
ユニチカ	1,200	360.00	432,000
富士紡ホールディングス	200	3,385.00	677,000
倉敷紡績	400	2,556.00	1,022,400
シキボウ	200	942.00	188,400

日本毛織	1,400	1,101.00	1,541,400
ダイトウボウ	600	84.00	50,400
トーア紡コーポレーション	100	534.00	53,400
ダイドーリミテッド	500	284.00	142,000
帝国繊維	500	2,066.00	1,033,000
帝人	3,400	2,128.00	7,235,200
東レ	30,000	785.30	23,559,000
サカイオーベックス	100	1,896.00	189,600
住江織物	100	2,960.00	296,000
日本フェルト	200	493.00	98,600
イチカワ	100	1,544.00	154,400
アツギ	300	832.00	249,600
ダイニック	100	782.00	78,200
セーレン	1,000	1,514.00	1,514,000
ソトー	200	985.00	197,000
東海染工	100	1,125.00	112,500
小松マテーレ	700	855.00	598,500
ワコールホールディングス	1,100	2,963.00	3,259,300
ホギメディカル	500	3,650.00	1,825,000
レナウン	1,000	112.00	112,000
クラウディアホールディングス	100	488.00	48,800
T S Iホールディングス	1,400	590.00	826,000
マツオカコーポレーション	100	1,993.00	199,300
ワールド	600	2,822.00	1,693,200
三陽商会	200	1,508.00	301,600
ナイガイ	100	471.00	47,100
オンワードホールディングス	2,500	629.00	1,572,500
ルックホールディングス	100	1,149.00	114,900
キムラタン	1,800	36.00	64,800
ゴールドウイン	700	7,780.00	5,446,000
デサント	800	1,609.00	1,287,200
キング	200	577.00	115,400
ヤマトインターナショナル	200	398.00	79,600
特種東海製紙	300	4,105.00	1,231,500
王子ホールディングス	17,300	627.00	10,847,100
日本製紙	1,800	1,872.00	3,369,600
三菱製紙	500	500.00	250,000
北越コーポレーション	2,800	578.00	1,618,400
中越パルプ工業	200	1,677.00	335,400
巴川製紙所	100	997.00	99,700
大王製紙	1,800	1,484.00	2,671,200
阿波製紙	100	421.00	42,100

レンゴー	3,900	816.00	3,182,400
トーモク	300	1,857.00	557,100
ザ・バック	300	3,785.00	1,135,500
クラレ	6,500	1,386.00	9,009,000
旭化成	27,700	1,272.00	35,234,400
共和レザー	200	814.00	162,800
昭和電工	2,900	3,135.00	9,091,500
住友化学	30,400	513.00	15,595,200
住友精化	200	3,755.00	751,000
日産化学	2,300	4,445.00	10,223,500
ラサ工業	200	1,538.00	307,600
クレハ	400	6,850.00	2,740,000
多木化学	100	4,550.00	455,000
テイカ	300	2,144.00	643,200
石原産業	700	1,250.00	875,000
片倉コープアグリ	100	1,206.00	120,600
日本曹達	600	3,075.00	1,845,000
東ソー	6,400	1,607.00	10,284,800
トクヤマ	1,200	3,085.00	3,702,000
セントラル硝子	800	2,760.00	2,208,000
東亜合成	2,600	1,249.00	3,247,400
大阪ソーダ	400	3,085.00	1,234,000
関東電化工業	1,000	956.00	956,000
デンカ	1,500	3,190.00	4,785,000
信越化学工業	7,300	12,245.00	89,388,500
日本カーバイド工業	100	1,487.00	148,700
堺化学工業	300	2,792.00	837,600
第一稀元素化学工業	400	869.00	347,600
エア・ウォーター	3,400	2,081.00	7,075,400
大陽日酸	4,000	2,613.00	10,452,000
日本化学工業	100	3,145.00	314,500
東邦アセチレン	100	1,367.00	136,700
日本パーカライジング	2,100	1,260.00	2,646,000
高圧ガス工業	700	891.00	623,700
四国化成工業	600	1,268.00	760,800
戸田工業	100	2,287.00	228,700
ステラ ケミファ	200	3,170.00	634,000
保土谷化学工業	200	4,055.00	811,000
日本触媒	600	6,840.00	4,104,000
大日精化工業	400	3,375.00	1,350,000
カネカ	1,100	3,795.00	4,174,500
三菱瓦斯化学	3,900	1,677.00	6,540,300

三井化学	3,800	2,728.00	10,366,400
J S R	3,900	2,133.00	8,318,700
東京応化工業	700	4,255.00	2,978,500
大阪有機化学工業	400	1,221.00	488,400
三菱ケミカルホールディングス	27,700	880.40	24,387,080
K Hネオケム	700	2,738.00	1,916,600
ダイセル	5,700	1,117.00	6,366,900
住友ベークライト	700	4,495.00	3,146,500
積水化学工業	8,900	1,944.00	17,301,600
日本ゼオン	3,700	1,340.00	4,958,000
アイカ工業	1,200	3,435.00	4,122,000
宇部興産	2,100	2,357.00	4,949,700
積水樹脂	700	2,257.00	1,579,900
タキロンシーアイ	900	694.00	624,600
旭有機材	200	1,718.00	343,600
日立化成	1,900	3,475.00	6,602,500
ニチバン	200	1,861.00	372,200
リケンテクノス	1,000	536.00	536,000
大倉工業	200	2,141.00	428,200
積水化成品工業	600	858.00	514,800
群栄化学工業	100	2,516.00	251,600
タイガースポリマー	200	591.00	118,200
ミライアル	200	1,425.00	285,000
ダイキアクシス	100	952.00	95,200
ダイキョーニシカワ	900	908.00	817,200
竹本容器	100	1,001.00	100,100
森六ホールディングス	200	2,477.00	495,400
日本化薬	2,600	1,352.00	3,515,200
カーリットホールディングス	400	632.00	252,800
日本精化	300	1,297.00	389,100
扶桑化学工業	400	3,050.00	1,220,000
トリケミカル研究所	100	7,630.00	763,000
A D E K A	1,900	1,624.00	3,085,600
日油	1,600	3,715.00	5,944,000
新日本理化	700	207.00	144,900
ハリマ化成グループ	300	1,267.00	380,100
花王	10,100	8,631.00	87,173,100
第一工業製薬	200	3,805.00	761,000
石原ケミカル	100	1,745.00	174,500
日華化学	100	913.00	91,300
ニイタカ	100	1,732.00	173,200
三洋化成工業	300	5,400.00	1,620,000

有機合成薬品工業	300	285.00	85,500
大日本塗料	500	1,138.00	569,000
日本ペイントホールディングス	3,400	6,140.00	20,876,000
関西ペイント	4,700	2,688.00	12,633,600
神東塗料	300	195.00	58,500
中国塗料	1,200	1,109.00	1,330,800
日本特殊塗料	300	1,390.00	417,000
藤倉化成	600	577.00	346,200
太陽ホールディングス	300	4,415.00	1,324,500
D I C	1,700	3,225.00	5,482,500
サカタインクス	900	1,249.00	1,124,100
東洋インキS Cホールディングス	900	2,758.00	2,482,200
T & K T O K A	300	1,053.00	315,900
富士フィルムホールディングス	8,100	4,840.00	39,204,000
資生堂	8,400	8,966.00	75,314,400
ライオン	5,500	2,160.00	11,880,000
高砂香料工業	300	2,809.00	842,700
マンダム	900	2,987.00	2,688,300
ミルボン	600	5,970.00	3,582,000
ファンケル	1,700	2,990.00	5,083,000
コーセー	800	17,980.00	14,384,000
コタ	200	1,364.00	272,800
シーボン	100	2,495.00	249,500
ポーラ・オルビスホールディングス	1,800	2,474.00	4,453,200
ノエビアホールディングス	400	5,770.00	2,308,000
アジュバンコスメジャパン	100	950.00	95,000
エステー	300	1,714.00	514,200
アグロ カネショウ	100	1,548.00	154,800
コニシ	700	1,496.00	1,047,200
長谷川香料	600	2,069.00	1,241,400
星光P M C	200	878.00	175,600
小林製薬	1,200	8,790.00	10,548,000
荒川化学工業	400	1,639.00	655,600
メック	300	1,850.00	555,000
日本高純度化学	100	2,603.00	260,300
タカラバイオ	1,100	2,206.00	2,426,600
J C U	500	2,710.00	1,355,000
新田ゼラチン	300	713.00	213,900
O A T アグリオ	100	1,794.00	179,400
デクセリアルズ	1,100	1,000.00	1,100,000
アース製薬	300	5,820.00	1,746,000
北興化学工業	400	627.00	250,800

大成ラミック	100	2,954.00	295,400
クミアイ化学工業	1,800	1,028.00	1,850,400
日本農薬	800	586.00	468,800
アキレス	300	1,841.00	552,300
有沢製作所	700	1,104.00	772,800
日東電工	2,900	6,240.00	18,096,000
レック	400	1,122.00	448,800
三光合成	500	414.00	207,000
きもと	700	178.00	124,600
藤森工業	400	3,710.00	1,484,000
前澤化成工業	300	1,227.00	368,100
未来工業	200	2,210.00	442,000
ウェーブロックホールディングス	100	784.00	78,400
J S P	200	1,980.00	396,000
エフピコ	500	6,790.00	3,395,000
天馬	300	2,040.00	612,000
信越ポリマー	800	980.00	784,000
東リ	1,000	306.00	306,000
ニフコ	1,500	2,945.00	4,417,500
バルカー	300	2,458.00	737,400
ユニ・チャーム	8,200	3,670.00	30,094,000
ショーエイコーポレーション	100	743.00	74,300
協和キリン	4,300	2,018.00	8,677,400
武田薬品工業	35,200	4,278.00	150,585,600
アステラス製薬	37,200	1,825.00	67,890,000
大日本住友製薬	3,100	1,864.00	5,778,400
塩野義製薬	5,400	6,360.00	34,344,000
田辺三菱製薬	5,200	1,330.00	6,916,000
わかもと製薬	500	275.00	137,500
あすか製薬	500	1,122.00	561,000
日本新薬	1,100	9,490.00	10,439,000
バイオフェルミン製薬	100	2,289.00	228,900
中外製薬	4,400	9,326.00	41,034,400
科研製薬	700	5,720.00	4,004,000
エーザイ	5,100	7,483.00	38,163,300
ロート製薬	2,200	3,290.00	7,238,000
小野薬品工業	10,000	2,163.50	21,635,000
久光製薬	1,200	5,090.00	6,108,000
持田製薬	600	4,375.00	2,625,000
参天製薬	7,900	1,996.00	15,768,400
扶桑薬品工業	100	2,128.00	212,800
日本ケミファ	100	3,035.00	303,500

ツムラ	1,300	3,210.00	4,173,000
日医工	1,200	1,283.00	1,539,600
キッセイ薬品工業	700	2,870.00	2,009,000
生化学工業	800	1,290.00	1,032,000
栄研化学	700	1,799.00	1,259,300
日水製薬	200	1,272.00	254,400
鳥居薬品	300	2,787.00	836,100
JCRファーマ	300	8,150.00	2,445,000
東和薬品	500	2,788.00	1,394,000
富士製薬工業	300	1,452.00	435,600
沢井製薬	900	6,080.00	5,472,000
ゼリア新薬工業	800	2,124.00	1,699,200
第一三共	12,100	6,840.00	82,764,000
キョーリン製薬ホールディングス	900	1,854.00	1,668,600
大幸薬品	200	2,820.00	564,000
ダイト	200	3,270.00	654,000
大塚ホールディングス	8,100	4,515.00	36,571,500
大正製薬ホールディングス	900	7,800.00	7,020,000
ペプチドリーム	2,100	5,100.00	10,710,000
日本コークス工業	3,500	86.00	301,000
ニチレキ	500	1,324.00	662,000
ユシロ化学工業	200	1,455.00	291,000
ビーピー・カストロール	200	1,511.00	302,200
富士石油	1,100	261.00	287,100
MORESCO	100	1,349.00	134,900
出光興産	4,800	3,205.00	15,384,000
JXTGホールディングス	65,600	519.50	34,079,200
コスモエネルギーホールディングス	1,200	2,374.00	2,848,800
横浜ゴム	2,400	2,496.00	5,990,400
TOYO TIRE	2,400	1,539.00	3,693,600
ブリヂストン	13,000	4,617.00	60,021,000
住友ゴム工業	3,800	1,413.00	5,369,400
藤倉コンポジット	300	506.00	151,800
オカモト	300	4,425.00	1,327,500
フコク	200	732.00	146,400
ニッタ	500	3,190.00	1,595,000
住友理工	800	994.00	795,200
三ツ星ベルト	600	2,073.00	1,243,800
バンドー化学	700	993.00	695,100
日東紡績	600	3,440.00	2,064,000
AGC	4,200	3,960.00	16,632,000
日本板硝子	2,000	657.00	1,314,000

石塚硝子	100	2,200.00	220,000
日本山村硝子	200	1,313.00	262,600
日本電気硝子	1,700	2,436.00	4,141,200
オハラ	200	1,477.00	295,400
住友大阪セメント	800	4,805.00	3,844,000
太平洋セメント	2,700	3,205.00	8,653,500
日本ヒューム	400	830.00	332,000
日本コンクリート工業	900	328.00	295,200
三谷セキサン	200	3,700.00	740,000
アジアパイルホールディングス	600	601.00	360,600
東海カーボン	4,400	1,078.00	4,743,200
日本カーボン	200	4,070.00	814,000
東洋炭素	200	2,602.00	520,400
ノリタケカンパニーリミテド	200	4,670.00	934,000
TOTO	3,000	4,590.00	13,770,000
日本碍子	5,100	1,847.00	9,419,700
日本特殊陶業	3,300	2,252.00	7,431,600
ダントーホールディングス	200	114.00	22,800
MARUWA	200	7,620.00	1,524,000
品川リフラクトリーズ	100	3,060.00	306,000
黒崎播磨	100	6,160.00	616,000
ヨータイ	300	722.00	216,600
イソライト工業	200	612.00	122,400
東京窯業	500	325.00	162,500
ニッカトー	200	792.00	158,400
フジインコーポレーテッド	400	2,947.00	1,178,800
クニミネ工業	100	1,026.00	102,600
エーアンドエーマテリアル	100	1,183.00	118,300
ニチアス	1,100	2,490.00	2,739,000
ニチハ	600	3,205.00	1,923,000
日本製鉄	18,700	1,594.50	29,817,150
神戸製鋼所	7,600	583.00	4,430,800
中山製鋼所	600	478.00	286,800
合同製鐵	200	2,680.00	536,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	11,300	1,384.00	15,639,200
東京製鐵	2,000	864.00	1,728,000
共英製鋼	500	2,215.00	1,107,500
大和工業	900	2,800.00	2,520,000
東京鐵鋼	200	1,609.00	321,800
大阪製鐵	200	1,479.00	295,800
淀川製鋼所	600	2,156.00	1,293,600
丸一鋼管	1,400	3,015.00	4,221,000

モリ工業	100	2,330.00	233,000
大同特殊鋼	700	5,110.00	3,577,000
日本高周波鋼業	200	440.00	88,000
日本冶金工業	300	2,492.00	747,600
山陽特殊製鋼	300	1,480.00	444,000
愛知製鋼	200	3,630.00	726,000
日立金属	4,500	1,411.00	6,349,500
日本金属	100	1,021.00	102,100
大太平洋金属	300	2,702.00	810,600
新日本電工	2,700	187.00	504,900
栗本鐵工所	200	1,991.00	398,200
虹技	100	1,418.00	141,800
三菱製鋼	300	1,182.00	354,600
日亜鋼業	600	347.00	208,200
日本精線	100	2,824.00	282,400
エンビプロ・ホールディングス	100	671.00	67,100
シンニッタン	600	452.00	271,200
新家工業	100	1,600.00	160,000
大紀アルミニウム工業所	700	768.00	537,600
日本軽金属ホールディングス	10,600	228.00	2,416,800
三井金属鉱業	1,100	3,205.00	3,525,500
東邦亜鉛	200	2,165.00	433,000
三菱マテリアル	2,800	3,215.00	9,002,000
住友金属鉱山	5,300	3,621.00	19,191,300
D O W Aホールディングス	1,100	4,000.00	4,400,000
古河機械金属	700	1,615.00	1,130,500
エス・サイエンス	1,700	53.00	90,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	400	1,670.00	668,000
東邦チタニウム	800	927.00	741,600
U A C J	600	2,508.00	1,504,800
C Kサンエツ	100	2,979.00	297,900
古河電気工業	1,300	3,110.00	4,043,000
住友電気工業	15,700	1,580.50	24,813,850
フジクラ	5,000	479.00	2,395,000
昭和電線ホールディングス	500	1,065.00	532,500
東京特殊電線	100	2,159.00	215,900
タツタ電線	800	593.00	474,400
カナレ電気	100	1,918.00	191,800
平河ビューテック	200	1,269.00	253,800
リョービ	500	2,088.00	1,044,000
アーレスティ	500	565.00	282,500
アサヒホールディングス	700	2,591.00	1,813,700

稲葉製作所	200	1,464.00	292,800
宮地エンジニアリンググループ	100	2,286.00	228,600
トーカロ	1,200	1,094.00	1,312,800
アルファC o	100	1,344.00	134,400
SUMCO	5,000	1,820.00	9,100,000
川田テクノロジーズ	100	7,340.00	734,000
RS Technologies	100	4,515.00	451,500
信和	200	1,030.00	206,000
東洋製罐グループホールディングス	2,700	1,971.00	5,321,700
ホッカンホールディングス	200	1,828.00	365,600
コロナ	200	1,154.00	230,800
横河ブリッジホールディングス	800	1,941.00	1,552,800
駒井ハルテック	100	1,755.00	175,500
三和ホールディングス	4,000	1,279.00	5,116,000
文化シャッター	1,200	982.00	1,178,400
三協立山	600	1,227.00	736,200
アルインコ	300	1,211.00	363,300
東洋シャッター	100	770.00	77,000
LIXILグループ	6,200	2,150.00	13,330,000
日本フィルコン	300	537.00	161,100
ノーリツ	900	1,396.00	1,256,400
長府製作所	400	2,482.00	992,800
リンナイ	800	8,200.00	6,560,000
ダイニチ工業	200	694.00	138,800
日東精工	600	605.00	363,000
三洋工業	100	2,003.00	200,300
岡部	900	945.00	850,500
ジーテクト	500	1,931.00	965,500
東プレ	800	1,928.00	1,542,400
高周波熱錬	800	927.00	741,600
東京製綱	300	1,160.00	348,000
サンコール	200	490.00	98,000
モリテック スチール	300	457.00	137,100
パイオラックス	600	2,241.00	1,344,600
エイチワン	400	756.00	302,400
日本発條	4,500	959.00	4,315,500
アドバネクス	100	1,678.00	167,800
立川ブラインド工業	200	1,465.00	293,000
三益半導体工業	400	2,122.00	848,800
日本ドライケミカル	100	1,321.00	132,100
日本製綱所	1,300	2,302.00	2,992,600
三浦工業	1,800	3,635.00	6,543,000

タクマ	1,400	1,319.00	1,846,600
ツガミ	900	1,055.00	949,500
オークマ	500	6,450.00	3,225,000
東芝機械	500	2,474.00	1,237,000
アマダホールディングス	5,300	1,265.00	6,704,500
アイダエンジニアリング	1,100	929.00	1,021,900
滝澤鉄工所	100	1,359.00	135,900
F U J I	1,800	1,801.00	3,241,800
牧野フライス製作所	500	5,180.00	2,590,000
オーエスジー	1,900	2,318.00	4,404,200
旭ダイヤモンド工業	1,100	653.00	718,300
D M G 森精機	2,600	1,777.00	4,620,200
ソディック	1,000	943.00	943,000
ディスコ	600	23,230.00	13,938,000
日東工器	200	2,357.00	471,400
日進工具	100	2,181.00	218,100
パンチ工業	400	548.00	219,200
富士ダイス	200	659.00	131,800
豊和工業	200	744.00	148,800
O K K	200	767.00	153,400
石川製作所	100	1,288.00	128,800
東洋機械金属	300	586.00	175,800
津田駒工業	100	1,300.00	130,000
エンシュウ	100	1,225.00	122,500
島精機製作所	700	2,785.00	1,949,500
オプトラン	500	3,405.00	1,702,500
N C ホールディングス	100	502.00	50,200
イワキポンプ	200	1,053.00	210,600
フリー	400	951.00	380,400
ヤマシンフィルタ	900	927.00	834,300
日阪製作所	500	976.00	488,000
やまびこ	800	1,272.00	1,017,600
平田機工	200	7,710.00	1,542,000
ペガサスミシン製造	400	526.00	210,400
マルマエ	200	1,011.00	202,200
タツモ	200	1,241.00	248,200
ナブテスコ	2,500	3,360.00	8,400,000
三井海洋開発	400	2,621.00	1,048,400
レオン自動機	400	1,646.00	658,400
S M C	1,300	49,950.00	64,935,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	300	562.00	168,600
ホソカワミクロン	100	4,155.00	415,500

ユニオンツール	200	3,490.00	698,000
オイレス工業	500	1,795.00	897,500
日精エー・エス・ピー機械	100	3,970.00	397,000
サトーホールディングス	600	3,320.00	1,992,000
技研製作所	400	4,075.00	1,630,000
日本エアージェット	100	687.00	68,700
カワタ	100	1,178.00	117,800
日精樹脂工業	300	1,135.00	340,500
オカダアイヨン	100	1,317.00	131,700
ワイエイシイホールディングス	200	895.00	179,000
小松製作所	19,200	2,649.50	50,870,400
住友重機械工業	2,400	3,315.00	7,956,000
日立建機	1,700	2,900.00	4,930,000
日工	600	682.00	409,200
巴工業	200	2,352.00	470,400
井関農機	400	1,728.00	691,200
TOWA	400	1,061.00	424,400
丸山製作所	100	1,258.00	125,800
北川鉄工所	200	2,147.00	429,400
ローツェ	200	3,680.00	736,000
タカキタ	100	568.00	56,800
クボタ	22,500	1,776.00	39,960,000
荏原実業	100	2,192.00	219,200
三菱化工機	100	1,951.00	195,100
月島機械	800	1,755.00	1,404,000
帝国電機製作所	300	1,330.00	399,000
東京機械製作所	200	384.00	76,800
新東工業	1,000	1,055.00	1,055,000
澁谷工業	400	2,953.00	1,181,200
アイチ コーポレーション	700	685.00	479,500
小森コーポレーション	1,100	1,169.00	1,285,900
鶴見製作所	300	2,142.00	642,600
住友精密工業	100	3,460.00	346,000
日本ギア工業	100	427.00	42,700
酒井重工業	100	3,330.00	333,000
荏原製作所	1,900	3,270.00	6,213,000
西島製作所	400	1,040.00	416,000
北越工業	400	1,280.00	512,000
ダイキン工業	5,400	15,430.00	83,322,000
オルガノ	200	6,120.00	1,224,000
トーヨーカネツ	200	1,996.00	399,200
栗田工業	2,300	3,185.00	7,325,500

椿本チエイン	600	3,920.00	2,352,000
大同工業	200	850.00	170,000
木村化工機	300	433.00	129,900
アネスト岩田	700	1,067.00	746,900
ダイフク	2,200	6,020.00	13,244,000
サムコ	100	1,134.00	113,400
加藤製作所	200	2,069.00	413,800
油研工業	100	1,662.00	166,200
タダノ	2,000	1,039.00	2,078,000
フジテック	1,500	1,606.00	2,409,000
C K D	1,200	1,592.00	1,910,400
キトー	300	1,650.00	495,000
平和	1,200	2,246.00	2,695,200
理想科学工業	400	1,798.00	719,200
S A N K Y O	900	3,795.00	3,415,500
日本金銭機械	500	974.00	487,000
マースグループホールディングス	300	2,028.00	608,400
福島工業	300	3,570.00	1,071,000
オーイズミ	200	543.00	108,600
ダイコク電機	200	1,519.00	303,800
竹内製作所	700	1,724.00	1,206,800
アマノ	1,100	3,100.00	3,410,000
J U K I	600	945.00	567,000
サンデンホールディングス	500	838.00	419,000
蛇の目ミシン工業	400	415.00	166,000
マックス	700	2,027.00	1,418,900
グローリー	1,200	3,265.00	3,918,000
新晃工業	400	1,861.00	744,400
大和冷機工業	600	1,246.00	747,600
セガサミーホールディングス	4,200	1,665.00	6,993,000
日本ピストンリング	100	1,409.00	140,900
リケン	200	4,230.00	846,000
T P R	600	1,968.00	1,180,800
ツバキ・ナカシマ	900	1,972.00	1,774,800
ホシザキ	1,200	9,660.00	11,592,000
大豊工業	300	871.00	261,300
日本精工	8,000	1,084.00	8,672,000
N T N	9,700	358.00	3,472,600
ジェイテクト	4,000	1,434.00	5,736,000
不二越	400	5,230.00	2,092,000
日本トムソン	1,200	494.00	592,800
T H K	2,500	3,175.00	7,937,500

ユーシン精機	300	1,061.00	318,300
前澤給装工業	200	2,143.00	428,600
イーグル工業	500	1,128.00	564,000
前澤工業	200	386.00	77,200
日本ピラー工業	400	1,484.00	593,600
キット	1,700	801.00	1,361,700
マキタ	5,500	3,670.00	20,185,000
日立造船	3,300	406.00	1,339,800
三菱重工業	7,100	4,372.00	31,041,200
I H I	3,000	2,614.00	7,842,000
スター精密	700	1,651.00	1,155,700
日清紡ホールディングス	2,800	933.00	2,612,400
イビデン	2,600	2,565.00	6,669,000
コニカミノルタ	9,300	719.00	6,686,700
ブラザー工業	5,200	2,190.00	11,388,000
ミネベアミツミ	7,900	2,150.00	16,985,000
日立製作所	20,300	4,197.00	85,199,100
三菱電機	42,300	1,605.00	67,891,500
富士電機	2,600	3,360.00	8,736,000
東洋電機製造	200	1,567.00	313,400
安川電機	4,600	4,325.00	19,895,000
シンフォニアテクノロジー	600	1,332.00	799,200
明電舎	800	2,123.00	1,698,400
オリジン	100	1,549.00	154,900
山洋電気	200	5,230.00	1,046,000
デンヨー	400	1,976.00	790,400
東芝テック	500	4,115.00	2,057,500
芝浦メカトロニクス	100	3,970.00	397,000
マブチモーター	1,200	4,620.00	5,544,000
日本電産	5,100	16,395.00	83,614,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	300	645.00	193,500
トレックス・セミコンダクター	300	1,481.00	444,300
東光高岳	200	1,207.00	241,400
ダブル・スコープ	600	655.00	393,000
宮越ホールディングス	200	1,079.00	215,800
ダイヘン	500	3,405.00	1,702,500
ヤーマン	600	685.00	411,000
JVCケンウッド	3,500	269.00	941,500
ミマキエンジニアリング	400	574.00	229,600
第一精工	200	2,689.00	537,800
日新電機	1,000	1,211.00	1,211,000
大崎電気工業	900	759.00	683,100

オムロン	3,900	6,530.00	25,467,000
日東工業	600	2,262.00	1,357,200
I D E C	600	2,327.00	1,396,200
正興電機製作所	100	830.00	83,000
不二電機工業	100	1,245.00	124,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,400	2,196.00	3,074,400
サクサホールディングス	100	1,883.00	188,300
メルコホールディングス	100	3,025.00	302,500
テクノメディカ	100	2,155.00	215,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	100	1,145.00	114,500
日本電気	5,100	4,370.00	22,287,000
富士通	4,100	9,458.00	38,777,800
沖電気工業	1,700	1,487.00	2,527,900
岩崎通信機	200	805.00	161,000
電気興業	200	3,250.00	650,000
サンケン電気	500	2,946.00	1,473,000
ナカヨ	100	1,698.00	169,800
アイホン	200	1,903.00	380,600
ルネサスエレクトロニクス	20,200	762.00	15,392,400
セイコーエプソン	5,300	1,564.00	8,289,200
ワコム	2,900	433.00	1,255,700
アルバック	800	4,840.00	3,872,000
アクセル	200	654.00	130,800
E I Z O	300	4,165.00	1,249,500
日本信号	1,100	1,369.00	1,505,900
京三製作所	1,000	507.00	507,000
能美防災	600	2,294.00	1,376,400
ホーチキ	300	1,500.00	450,000
星和電機	200	575.00	115,000
エレコム	500	4,025.00	2,012,500
パナソニック	48,400	1,021.00	49,416,400
シャープ	4,900	1,617.00	7,923,300
アンリツ	2,700	2,181.00	5,888,700
富士通ゼネラル	1,200	1,961.00	2,353,200
ソニー	26,700	6,552.00	174,938,400
T D K	2,000	11,390.00	22,780,000
帝国通信工業	200	1,175.00	235,000
タムラ製作所	1,400	630.00	882,000
アルプスアルパイン	3,700	2,391.00	8,846,700
池上通信機	100	1,134.00	113,400
日本電波工業	400	477.00	190,800
鈴木	200	793.00	158,600

日本トリム	100	5,150.00	515,000
ローランド ディー.ジー.	200	2,190.00	438,000
フォスター電機	500	2,031.00	1,015,500
S M K	100	3,005.00	300,500
ヨコオ	300	3,225.00	967,500
ティアック	400	200.00	80,000
ホシデン	1,200	1,195.00	1,434,000
ヒロセ電機	700	13,720.00	9,604,000
日本航空電子工業	1,000	2,136.00	2,136,000
T O A	500	1,155.00	577,500
マクセルホールディングス	900	1,486.00	1,337,400
古野電気	600	1,150.00	690,000
ユニデンホールディングス	100	1,996.00	199,600
スミダコーポレーション	300	1,249.00	374,700
アイコム	200	2,455.00	491,000
リオン	200	2,596.00	519,200
本多通信工業	400	500.00	200,000
船井電機	400	657.00	262,800
横河電機	3,900	1,930.00	7,527,000
新電元工業	200	3,655.00	731,000
アズビル	2,700	3,090.00	8,343,000
東亜ディーケーケー	200	852.00	170,400
日本光電工業	1,800	3,060.00	5,508,000
チノー	200	1,472.00	294,400
共和電業	500	426.00	213,000
日本電子材料	200	726.00	145,200
堀場製作所	800	7,490.00	5,992,000
アドバンテスト	3,100	5,370.00	16,647,000
小野測器	200	518.00	103,600
エスベック	400	1,973.00	789,200
キーエンス	1,900	75,010.00	142,519,000
日置電機	200	3,785.00	757,000
シスメックス	3,000	7,977.00	23,931,000
日本マイクロニクス	800	1,037.00	829,600
メガチップス	400	2,316.00	926,400
O B A R A G R O U P	200	3,965.00	793,000
澤藤電機	100	1,804.00	180,400
原田工業	200	920.00	184,000
コーセル	500	1,227.00	613,500
イリソ電子工業	400	5,660.00	2,264,000
オブテックスグループ	700	1,684.00	1,178,800
千代田インテグレ	200	2,395.00	479,000

アイ・オー・データ機器	200	937.00	187,400
レーザーテック	900	7,960.00	7,164,000
スタンレー電気	3,000	3,020.00	9,060,000
岩崎電気	200	1,464.00	292,800
ウシオ電機	2,500	1,642.00	4,105,000
岡谷電機産業	300	401.00	120,300
ハリオス テクノ ホールディング	400	499.00	199,600
エノモト	100	1,163.00	116,300
日本セラミック	400	2,829.00	1,131,600
遠藤照明	200	693.00	138,600
古河電池	300	739.00	221,700
双信電機	200	457.00	91,400
山一電機	300	1,726.00	517,800
図研	300	2,394.00	718,200
日本電子	800	3,015.00	2,412,000
カシオ計算機	3,700	1,768.00	6,541,600
ファナック	4,000	21,630.00	86,520,000
日本シイエムケイ	1,000	717.00	717,000
エンプラス	200	3,580.00	716,000
大真空	200	1,162.00	232,400
ローム	1,900	8,730.00	16,587,000
浜松ホトニクス	3,000	4,315.00	12,945,000
三井ハイテック	500	1,946.00	973,000
新光電気工業	1,400	1,083.00	1,516,200
京セラ	6,000	7,164.00	42,984,000
太陽誘電	1,900	3,010.00	5,719,000
村田製作所	12,400	6,295.00	78,058,000
双葉電子工業	700	1,422.00	995,400
北陸電気工業	200	1,171.00	234,200
ニチコン	1,500	1,146.00	1,719,000
日本ケミコン	300	1,736.00	520,800
K O A	700	1,419.00	993,300
市光工業	600	883.00	529,800
小糸製作所	2,500	6,030.00	15,075,000
ミツバ	800	700.00	560,000
S C R E E Nホールディングス	700	7,530.00	5,271,000
キャノン電子	500	2,007.00	1,003,500
キャノン	22,800	2,978.50	67,909,800
リコー	10,800	1,040.00	11,232,000
象印マホービン	1,200	1,719.00	2,062,800
M U T O Hホールディングス	100	1,826.00	182,600
東京エレクトロン	2,800	22,160.00	62,048,000

トヨタ紡織	1,200	1,711.00	2,053,200	
芦森工業	100	1,547.00	154,700	
ユニプレス	800	1,639.00	1,311,200	
豊田自動織機	3,400	6,550.00	22,270,000	
モリタホールディングス	700	1,893.00	1,325,100	
三櫻工業	500	1,473.00	736,500	
デンソー	9,300	5,026.00	46,741,800	
東海理化電機製作所	1,100	2,170.00	2,387,000	
三井E & Sホールディングス	1,500	893.00	1,339,500	
川崎重工業	3,300	2,587.00	8,537,100	
名村造船所	1,300	293.00	380,900	
サノヤスホールディングス	500	195.00	97,500	
日本車輛製造	200	2,865.00	573,000	
三菱ロジスネクスト	600	1,045.00	627,000	
近畿車輛	100	1,621.00	162,100	
日産自動車	49,900	697.30	34,795,270	
いすゞ自動車	12,300	1,269.50	15,614,850	
トヨタ自動車	47,100	7,736.00	364,365,600	代用有価証券 2,300株
日野自動車	5,300	1,049.00	5,559,700	
三菱自動車工業	15,600	492.00	7,675,200	
エフテック	300	782.00	234,600	
レシップホールディングス	100	670.00	67,000	
G M B	100	801.00	80,100	
ファルテック	100	801.00	80,100	
武蔵精密工業	1,000	1,592.00	1,592,000	
日産車体	800	1,033.00	826,400	
新明和工業	1,100	1,360.00	1,496,000	
極東開発工業	800	1,557.00	1,245,600	
日信工業	900	2,230.00	2,007,000	
トピー工業	400	2,178.00	871,200	
ティラド	200	2,016.00	403,200	
タチエス	700	1,492.00	1,044,400	
N O K	2,300	1,749.00	4,022,700	
フタバ産業	1,200	815.00	978,000	
K Y B	500	3,595.00	1,797,500	
大同メタル工業	800	699.00	559,200	
プレス工業	2,100	476.00	999,600	
ミクニ	500	367.00	183,500	
太平洋工業	900	1,565.00	1,408,500	
ケーヒン	1,000	2,575.00	2,575,000	
河西工業	600	921.00	552,600	
アイシン精機	3,500	4,360.00	15,260,000	

マツダ	12,400	1,002.00	12,424,800	
今仙電機製作所	400	952.00	380,800	
本田技研工業	33,300	3,014.00	100,366,200	代用有価証券 4,700株
スズキ	8,400	5,164.00	43,377,600	
S U B A R U	13,100	3,083.00	40,387,300	
安永	200	1,342.00	268,400	
ヤマハ発動機	5,500	2,198.00	12,089,000	
ショーワ	1,000	2,285.00	2,285,000	
T B K	500	460.00	230,000	
エクセディ	600	2,521.00	1,512,600	
豊田合成	1,400	2,600.00	3,640,000	
愛三工業	700	918.00	642,600	
盟和産業	100	1,137.00	113,700	
日本プラスト	300	701.00	210,300	
ヨロズ	400	1,405.00	562,000	
エフ・シー・シー	700	2,510.00	1,757,000	
シマノ	1,600	17,810.00	28,496,000	
テイ・エス テック	1,000	3,355.00	3,355,000	
ジャムコ	200	1,501.00	300,200	
テルモ	12,000	3,542.00	42,504,000	
クリエートメディック	100	1,052.00	105,200	
日機装	1,300	1,200.00	1,560,000	
日本エム・ディ・エム	200	2,012.00	402,400	
島津製作所	5,100	3,045.00	15,529,500	
J M S	400	689.00	275,600	
クボテック	100	427.00	42,700	
長野計器	300	770.00	231,000	
ブイ・テクノロジー	200	6,390.00	1,278,000	
東京計器	300	959.00	287,700	
愛知時計電機	100	4,280.00	428,000	
インターアクション	200	2,100.00	420,000	
オーバル	300	256.00	76,800	
東京精密	800	3,525.00	2,820,000	
マニー	1,700	2,939.00	4,996,300	
ニコン	6,800	1,431.00	9,730,800	
トプコン	2,100	1,477.00	3,101,700	
オリンパス	23,400	1,700.00	39,780,000	
理研計器	400	2,235.00	894,000	
タムロン	300	2,413.00	723,900	
H O Y A	8,500	9,324.00	79,254,000	
シード	200	884.00	176,800	
ノーリツ鋼機	300	1,625.00	487,500	

エー・アンド・デイ	400	844.00	337,600
朝日インテック	3,600	3,040.00	10,944,000
シチズン時計	4,900	607.00	2,974,300
リズム時計工業	100	994.00	99,400
大研医器	300	546.00	163,800
メニコン	600	3,750.00	2,250,000
松風	200	1,754.00	350,800
セイコーホールディングス	600	2,728.00	1,636,800
ニプロ	2,900	1,240.00	3,596,000
中本パックス	100	1,497.00	149,700
スノーピーク	200	1,047.00	209,400
パラマウントベッドホールディングス	400	4,140.00	1,656,000
トランザクション	300	962.00	288,600
S H O - B I	100	398.00	39,800
ニホンフラッシュ	200	2,476.00	495,200
前田工織	500	1,824.00	912,000
永大産業	500	363.00	181,500
アートネイチャー	400	762.00	304,800
バンダイナムコホールディングス	4,400	6,711.00	29,528,400
アイフィスジャパン	100	786.00	78,600
共立印刷	700	166.00	116,200
S H O E I	200	5,000.00	1,000,000
フランスベッドホールディングス	600	1,010.00	606,000
パイロットコーポレーション	700	4,395.00	3,076,500
萩原工業	200	1,616.00	323,200
トッパン・フォームズ	900	1,091.00	981,900
フジシールインターナショナル	900	2,728.00	2,455,200
タカラトミー	1,900	1,205.00	2,289,500
廣済堂	300	720.00	216,000
エステールホールディングス	100	654.00	65,400
アーク	1,500	95.00	142,500
タカノ	200	821.00	164,200
プロネクサス	400	1,250.00	500,000
ホクシン	300	167.00	50,100
ウッドワン	100	1,165.00	116,500
大建工業	300	1,974.00	592,200
凸版印刷	6,000	2,058.00	12,348,000
大日本印刷	5,500	2,974.00	16,357,000
共同印刷	100	2,783.00	278,300
N I S S H A	900	1,243.00	1,118,700
宝印刷	200	1,770.00	354,000
アシックス	3,500	1,621.00	5,673,500

ツツミ	100	2,054.00	205,400
小松ウオール工業	100	2,234.00	223,400
ヤマハ	2,500	5,830.00	14,575,000
河合楽器製作所	100	3,175.00	317,500
クリナップ	400	652.00	260,800
ピジョン	2,600	5,340.00	13,884,000
キングジム	300	876.00	262,800
リンテック	1,000	2,334.00	2,334,000
イトーキ	900	479.00	431,100
任天堂	2,600	42,000.00	109,200,000
三菱鉛筆	700	1,779.00	1,245,300
タカラスタANDARD	900	1,996.00	1,796,400
コクヨ	2,000	1,634.00	3,268,000
ナカバヤシ	400	576.00	230,400
グローブライド	200	2,776.00	555,200
オカムラ	1,500	1,064.00	1,596,000
美津濃	400	2,831.00	1,132,400
東京電力ホールディングス	33,800	508.00	17,170,400
中部電力	13,000	1,597.50	20,767,500
関西電力	16,100	1,267.50	20,406,750
中国電力	5,800	1,492.00	8,653,600
北陸電力	3,900	827.00	3,225,300
東北電力	10,600	1,148.00	12,168,800
四国電力	3,800	1,149.00	4,366,200
九州電力	8,700	985.00	8,569,500
北海道電力	3,900	563.00	2,195,700
沖縄電力	800	2,024.00	1,619,200
電源開発	3,400	2,662.00	9,050,800
エフオン	200	760.00	152,000
イーレックス	600	1,551.00	930,600
レノバ	700	1,127.00	788,900
東京瓦斯	8,100	2,611.50	21,153,150
大阪瓦斯	8,200	2,130.00	17,466,000
東邦瓦斯	2,100	4,280.00	8,988,000
北海道瓦斯	200	1,621.00	324,200
広島ガス	900	361.00	324,900
西部瓦斯	500	2,557.00	1,278,500
静岡ガス	1,200	904.00	1,084,800
メタウォーター	200	4,055.00	811,000
SBSホールディングス	400	1,827.00	730,800
東武鉄道	4,500	3,940.00	17,730,000
相鉄ホールディングス	1,400	3,035.00	4,249,000

東急	10,700	2,111.00	22,587,700
京浜急行電鉄	5,400	2,201.00	11,885,400
小田急電鉄	6,300	2,727.00	17,180,100
京王電鉄	2,200	6,920.00	15,224,000
京成電鉄	2,900	4,570.00	13,253,000
富士急行	600	4,295.00	2,577,000
新京成電鉄	100	2,217.00	221,700
東日本旅客鉄道	7,400	10,065.00	74,481,000
西日本旅客鉄道	3,800	9,816.00	37,300,800
東海旅客鉄道	3,500	22,630.00	79,205,000
西武ホールディングス	5,700	1,930.00	11,001,000
鴻池運輸	700	1,669.00	1,168,300
西日本鉄道	1,200	2,636.00	3,163,200
ハマキョウレックス	300	3,640.00	1,092,000
サカイ引越センター	200	6,420.00	1,284,000
近鉄グループホールディングス	4,000	6,110.00	24,440,000
阪急阪神ホールディングス	5,400	4,605.00	24,867,000
南海電気鉄道	1,900	3,010.00	5,719,000
京阪ホールディングス	1,800	5,350.00	9,630,000
神戸電鉄	100	3,950.00	395,000
名古屋鉄道	3,300	3,550.00	11,715,000
山陽電気鉄道	300	2,212.00	663,600
日本通運	1,400	6,630.00	9,282,000
ヤマトホールディングス	7,000	1,813.00	12,691,000
山九	1,100	5,870.00	6,457,000
丸運	400	275.00	110,000
丸全昭和運輸	300	3,110.00	933,000
センコーグループホールディングス	2,200	872.00	1,918,400
トナミホールディングス	100	5,110.00	511,000
ニッコンホールディングス	1,400	2,656.00	3,718,400
日本石油輸送	100	2,853.00	285,300
福山通運	500	4,040.00	2,020,000
セイノーホールディングス	3,000	1,428.00	4,284,000
エスライン	100	980.00	98,000
神奈川中央交通	100	3,975.00	397,500
日立物流	700	3,155.00	2,208,500
丸和運輸機関	400	2,375.00	950,000
C & F ロジホールディングス	400	1,434.00	573,600
九州旅客鉄道	3,600	3,715.00	13,374,000
S Gホールディングス	4,200	2,664.00	11,188,800
日本郵船	3,400	2,033.00	6,912,200
商船三井	2,500	3,005.00	7,512,500

川崎汽船	1,200	1,730.00	2,076,000
N S ユナイテッド海運	200	2,395.00	479,000
明治海運	500	343.00	171,500
飯野海運	2,000	367.00	734,000
共栄タンカー	100	1,496.00	149,600
乾汽船	200	1,176.00	235,200
日本航空	7,400	3,417.00	25,285,800
A N A ホールディングス	7,300	3,775.00	27,557,500
パスコ	100	1,172.00	117,200
ランコム	100	7,200.00	720,000
日新	300	1,753.00	525,900
三菱倉庫	1,300	2,852.00	3,707,600
三井倉庫ホールディングス	500	1,966.00	983,000
住友倉庫	1,500	1,508.00	2,262,000
澁澤倉庫	200	2,174.00	434,800
東陽倉庫	700	335.00	234,500
日本トランスシティ	900	561.00	504,900
ケイヒン	100	1,341.00	134,100
中央倉庫	200	1,250.00	250,000
川西倉庫	100	1,158.00	115,800
安田倉庫	300	1,020.00	306,000
ファイズホールディングス	100	681.00	68,100
東洋埠頭	100	1,412.00	141,200
宇徳	300	535.00	160,500
上組	2,300	2,444.00	5,621,200
サンリツ	100	691.00	69,100
キムラユニティー	100	1,110.00	111,000
キューソー流通システム	100	1,988.00	198,800
近鉄エクスプレス	900	1,847.00	1,662,300
東海運	200	288.00	57,600
エーアイティー	300	941.00	282,300
内外トランスライン	100	1,494.00	149,400
日本コンセプト	100	1,456.00	145,600
N E C ネットエスアイ	400	3,460.00	1,384,000
クロスキャット	100	1,023.00	102,300
システナ	1,500	1,543.00	2,314,500
デジタルアーツ	200	6,040.00	1,208,000
日鉄ソリューションズ	600	3,525.00	2,115,000
キューブシステム	200	794.00	158,800
エイジア	100	1,312.00	131,200
コア	200	1,406.00	281,200
ソリトンシステムズ	200	981.00	196,200

ソフトクリエイティブホールディングス	200	1,791.00	358,200
T I S	1,400	6,370.00	8,918,000
ネオス	200	780.00	156,000
電算システム	200	2,935.00	587,000
グリー	2,900	553.00	1,603,700
コーエーテクモホールディングス	900	2,503.00	2,252,700
三菱総合研究所	200	3,710.00	742,000
ボルテージ	100	545.00	54,500
A G S	200	779.00	155,800
ファインデックス	400	975.00	390,000
ブレインパッド	100	5,500.00	550,000
K L a b	800	936.00	748,800
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	500	1,050.00	525,000
イーブックイニシアティブジャパン	100	1,929.00	192,900
ネクソン	11,800	1,267.00	14,950,600
アイスタイル	1,100	834.00	917,400
エムアップ	100	1,940.00	194,000
エイチーム	300	1,054.00	316,200
エニグモ	300	953.00	285,900
テクノスジャパン	300	474.00	142,200
e n i s h	200	660.00	132,000
コロプラ	1,400	1,276.00	1,786,400
ブロードリーフ	2,100	610.00	1,281,000
クロス・マーケティンググループ	200	383.00	76,600
デジタルハーツホールディングス	200	864.00	172,800
システム情報	200	1,003.00	200,600
メディアドゥホールディングス	100	3,350.00	335,000
じげん	1,000	606.00	606,000
ブイキューブ	200	462.00	92,400
エンカレッジ・テクノロジー	100	770.00	77,000
サイバーリンクス	100	1,206.00	120,600
フィックスターズ	400	1,507.00	602,800
C A R T A H O L D I N G S	200	1,213.00	242,600
オブティム	100	2,645.00	264,500
セレス	100	1,208.00	120,800
ティーガイア	400	2,680.00	1,072,000
セック	100	3,260.00	326,000
日本アジアグループ	400	384.00	153,600
豆蔵ホールディングス	300	1,684.00	505,200
テクマトリックス	300	2,278.00	683,400
プロシップ	100	1,269.00	126,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,000	2,357.00	2,357,000

GMOペイメントゲートウェイ	700	8,090.00	5,663,000
ザッパラス	200	382.00	76,400
システムリサーチ	100	1,934.00	193,400
インターネットイニシアティブ	600	2,599.00	1,559,400
さくらインターネット	500	634.00	317,000
ヴィンクス	100	1,214.00	121,400
GMOクラウド	100	2,691.00	269,100
SRAホールディングス	200	2,616.00	523,200
Minor iソリューションズ	100	2,696.00	269,600
システムインテグレータ	100	773.00	77,300
朝日ネット	300	674.00	202,200
eBASE	300	1,195.00	358,500
アバント	200	2,114.00	422,800
アドソル日進	100	2,221.00	222,100
フリービット	300	852.00	255,600
コムチュア	500	2,077.00	1,038,500
サイバーコム	100	2,081.00	208,100
アステリア	300	664.00	199,200
アイル	100	1,233.00	123,300
マークラインズ	200	2,158.00	431,600
メディカル・データ・ビジョン	300	1,111.00	333,300
gumi	500	740.00	370,000
ショーケース	100	690.00	69,000
モバイルファクトリー	100	1,398.00	139,800
テラスカイ	200	2,169.00	433,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	200	1,658.00	331,600
PCIホールディングス	100	2,126.00	212,600
パイプドHD	100	1,699.00	169,900
アイビーシー	100	1,086.00	108,600
ネオジャパン	100	980.00	98,000
ランドコンピュータ	100	1,118.00	111,800
ダブルスタンダード	100	5,300.00	530,000
オープンドア	200	1,926.00	385,200
マイネット	100	522.00	52,200
アカツキ	100	6,040.00	604,000
Ubicomホールディングス	100	1,413.00	141,300
LINE	900	4,415.00	3,973,500
カナミックネットワーク	300	613.00	183,900
ノムラシステムコーポレーション	100	544.00	54,400
チェンジ	100	2,063.00	206,300
シンクロ・フード	200	512.00	102,400
オークネット	300	1,500.00	450,000

エイトレッド	100	1,433.00	143,300
AOI TYO Holdings	400	652.00	260,800
マクロミル	700	1,005.00	703,500
ビーグリー	100	987.00	98,700
オロ	100	2,926.00	292,600
テモナ	100	497.00	49,700
ニーズウェル	100	697.00	69,700
サインポスト	100	1,910.00	191,000
ソルクシーズ	200	900.00	180,000
フェイス	100	747.00	74,700
プロトコーポレーション	400	1,177.00	470,800
野村総合研究所	6,900	2,346.00	16,187,400
サイバネットシステム	300	711.00	213,300
CEホールディングス	200	468.00	93,600
日本システム技術	100	1,309.00	130,900
インテージホールディングス	500	992.00	496,000
東邦システムサイエンス	100	951.00	95,100
ソースネクスト	2,000	490.00	980,000
インフォコム	500	2,275.00	1,137,500
ラクスル	200	3,700.00	740,000
FIG	400	327.00	130,800
アルテリア・ネットワークス	500	1,482.00	741,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	1,606.00	160,600
フォーカスシステムズ	300	893.00	267,900
クレスコ	100	3,570.00	357,000
フジ・メディア・ホールディングス	4,000	1,453.00	5,812,000
オービック	1,400	13,640.00	19,096,000
ジャストシステム	700	4,605.00	3,223,500
TDCソフト	400	861.00	344,400
Zホールディングス	57,000	372.00	21,204,000
トレンドマイクロ	1,800	5,410.00	9,738,000
IDホールディングス	200	1,379.00	275,800
日本オラクル	800	9,470.00	7,576,000
アルファシステムズ	100	2,881.00	288,100
フューチャー	500	1,745.00	872,500
CAC Holdings	300	1,397.00	419,100
SBテクノロジー	200	2,006.00	401,200
トーセ	100	900.00	90,000
オービックビジネスコンサルタント	400	4,360.00	1,744,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,900	2,902.00	5,513,800
アイティフォー	500	876.00	438,000
東計電算	100	3,380.00	338,000

エクスネット	100	976.00	97,600
大塚商会	2,200	4,140.00	9,108,000
サイボウズ	500	1,132.00	566,000
ソフトブレーン	200	537.00	107,400
電通国際情報サービス	300	3,715.00	1,114,500
デジタルガレージ	700	3,575.00	2,502,500
E Mシステムズ	300	2,085.00	625,500
ウェザーニューズ	100	3,475.00	347,500
C I J	300	931.00	279,300
日本エンタープライズ	400	229.00	91,600
WOWOW	200	2,697.00	539,400
スカラ	300	849.00	254,700
インテリジェント ウェイブ	200	745.00	149,000
I M A G I C A G R O U P	400	629.00	251,600
ネットワンシステムズ	1,600	2,903.00	4,644,800
システムソフト	1,000	115.00	115,000
アルゴグラフィックス	400	3,035.00	1,214,000
マーベラス	600	804.00	482,400
エイベックス	700	1,385.00	969,500
日本ユニシス	1,300	3,490.00	4,537,000
兼松エレクトロニクス	200	3,375.00	675,000
東京放送ホールディングス	2,500	1,759.00	4,397,500
日本テレビホールディングス	3,500	1,412.00	4,942,000
朝日放送グループホールディングス	400	753.00	301,200
テレビ朝日ホールディングス	1,100	1,731.00	1,904,100
スカパーJ S A Tホールディングス	2,800	466.00	1,304,800
テレビ東京ホールディングス	300	2,259.00	677,700
日本BS放送	100	1,083.00	108,300
ビジョン	400	1,582.00	632,800
スマートバリュー	100	785.00	78,500
U S E N - N E X T H O L D I N G S	200	1,013.00	202,600
コネクシオ	200	1,523.00	304,600
クロップス	100	728.00	72,800
日本電信電話	27,700	5,500.00	152,350,000
K D D I	30,900	3,200.00	98,880,000
ソフトバンク	37,700	1,485.50	56,003,350
光通信	400	24,500.00	9,800,000
N T T ドコモ	30,700	3,015.00	92,560,500
エムティーアイ	400	716.00	286,400
G M O インターネット	1,600	1,915.00	3,064,000
ファイバーゲート	100	1,443.00	144,300
アйдママーケティングコミュニケーション	100	784.00	78,400

KADOKAWA	1,100	1,478.00	1,625,800
学研ホールディングス	100	5,840.00	584,000
ゼンリン	800	1,991.00	1,592,800
昭文社	200	414.00	82,800
インプレスホールディングス	400	162.00	64,800
アイネット	200	1,325.00	265,000
松竹	300	15,960.00	4,788,000
東宝	2,500	4,375.00	10,937,500
東映	200	15,040.00	3,008,000
エヌ・ティ・ティ・データ	11,100	1,490.00	16,539,000
ピー・シー・エー	100	3,500.00	350,000
ビジネスブレイン太田昭和	100	2,587.00	258,700
D T S	900	2,260.00	2,034,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,800	5,030.00	9,054,000
シーイーシー	500	1,963.00	981,500
カプコン	2,000	2,528.00	5,056,000
アイ・エス・ビー	100	1,819.00	181,900
ジャステック	300	1,154.00	346,200
S C S K	1,000	5,660.00	5,660,000
日本システムウエア	100	2,531.00	253,100
アイネス	400	1,257.00	502,800
T K C	400	4,635.00	1,854,000
富士ソフト	500	4,760.00	2,380,000
N S D	700	3,405.00	2,383,500
コナミホールディングス	1,500	4,590.00	6,885,000
福井コンピュータホールディングス	200	3,085.00	617,000
J B C Cホールディングス	300	1,702.00	510,600
ミロク情報サービス	400	2,908.00	1,163,200
ソフトバンクグループ	32,900	4,226.00	139,035,400
高千穂交易	200	1,112.00	222,400
伊藤忠食品	100	5,300.00	530,000
エレマテック	400	1,093.00	437,200
J A L U X	100	2,578.00	257,800
あらた	300	4,200.00	1,260,000
トーメンデバイス	100	2,715.00	271,500
東京エレクトロン デバイス	200	2,078.00	415,600
フィールズ	300	551.00	165,300
双日	23,000	347.00	7,981,000
アルフレッサ ホールディングス	4,600	2,429.00	11,173,400
横浜冷凍	1,200	1,101.00	1,321,200
神栄	100	752.00	75,200
ラサ商事	200	884.00	176,800

ラクーンホールディングス	200	658.00	131,600
アルコニックス	400	1,367.00	546,800
神戸物産	1,400	3,115.00	4,361,000
あいホールディングス	600	1,966.00	1,179,600
ディーブイエックス	100	944.00	94,400
ダイワボウホールディングス	400	4,805.00	1,922,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	1,812.00	1,812,000
ラクト・ジャパン	200	3,530.00	706,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	800	1,086.00	868,800
八洲電機	300	903.00	270,900
メディアスホールディングス	200	809.00	161,800
レスターホールディングス	400	1,916.00	766,400
ジューテックホールディングス	100	1,085.00	108,500
大光	200	734.00	146,800
OCHIホールディングス	100	1,380.00	138,000
TOKAIホールディングス	2,200	1,087.00	2,391,400
黒谷	100	460.00	46,000
Cominix	100	817.00	81,700
三洋貿易	200	2,331.00	466,200
ビューティガレージ	100	1,578.00	157,800
ウイン・パートナーズ	300	1,467.00	440,100
ミタチ産業	100	771.00	77,100
シップヘルスケアホールディングス	700	4,660.00	3,262,000
明治電機工業	100	1,534.00	153,400
デリカフーズホールディングス	100	691.00	69,100
スターティアホールディングス	100	644.00	64,400
コメダホールディングス	900	2,054.00	1,848,600
富士興産	100	702.00	70,200
小野建	400	1,431.00	572,400
南陽	100	1,765.00	176,500
佐島電機	300	945.00	283,500
エコートレーディング	100	536.00	53,600
伯東	300	1,362.00	408,600
コンドーテック	300	992.00	297,600
中山福	200	556.00	111,200
ナガイレーベン	600	2,531.00	1,518,600
三菱食品	500	2,812.00	1,406,000
松田産業	300	1,657.00	497,100
第一興商	600	5,180.00	3,108,000
メディバルホールディングス	4,500	2,498.00	11,241,000
S P K	100	2,729.00	272,900
萩原電気ホールディングス	200	2,907.00	581,400

アズワン	300	9,180.00	2,754,000
スズデン	100	1,409.00	140,900
尾家産業	100	1,303.00	130,300
シモジマ	300	1,243.00	372,900
ドウシシャ	400	1,755.00	702,000
小津産業	100	1,851.00	185,100
高速	300	1,323.00	396,900
たけびし	200	1,441.00	288,200
リックス	100	1,627.00	162,700
丸文	400	616.00	246,400
ハピネット	400	1,383.00	553,200
橋本総業ホールディングス	100	1,724.00	172,400
日本ライフライン	1,200	1,473.00	1,767,600
タカショー	200	482.00	96,400
エクセル	100	1,258.00	125,800
マルカ	200	2,373.00	474,600
I D O M	1,100	474.00	521,400
進和	200	2,527.00	505,400
エスケイジャパン	100	453.00	45,300
ダイトロン	200	1,573.00	314,600
シークス	500	1,639.00	819,500
田中商事	100	684.00	68,400
オーハシテクニカ	200	1,445.00	289,000
白銅	200	1,417.00	283,400
伊藤忠商事	28,300	2,304.00	65,203,200
丸紅	43,400	785.80	34,103,720
高島	100	1,730.00	173,000
長瀬産業	2,300	1,619.00	3,723,700
蝶理	300	1,920.00	576,000
豊田通商	4,700	3,715.00	17,460,500
三共生興	600	587.00	352,200
兼松	1,600	1,393.00	2,228,800
ツカモトコーポレーション	100	1,091.00	109,100
三井物産	36,600	1,902.50	69,631,500
日本紙パルプ商事	200	4,140.00	828,000
日立ハイテクノロジーズ	1,400	6,820.00	9,548,000
カメイ	500	1,259.00	629,500
東都水産	100	2,567.00	256,700
O U Gホールディングス	100	2,781.00	278,100
スターゼン	200	4,595.00	919,000
山善	1,600	1,027.00	1,643,200
椿本興業	100	4,195.00	419,500

住友商事	26,300	1,651.50	43,434,450
内田洋行	200	4,210.00	842,000
三菱商事	29,200	2,804.00	81,876,800
第一実業	200	3,655.00	731,000
キヤノンマーケティングジャパン	1,200	2,342.00	2,810,400
西華産業	200	1,435.00	287,000
佐藤商事	300	906.00	271,800
菱洋エレクトロ	400	1,945.00	778,000
東京産業	400	571.00	228,400
ユアサ商事	400	3,550.00	1,420,000
神鋼商事	100	2,606.00	260,600
小林産業	200	319.00	63,800
阪和興業	800	3,220.00	2,576,000
正栄食品工業	300	3,245.00	973,500
カナデン	300	1,379.00	413,700
菱電商事	300	1,688.00	506,400
フルサト工業	200	1,639.00	327,800
岩谷産業	900	3,735.00	3,361,500
すてきナイスグループ	200	956.00	191,200
昭光通商	100	657.00	65,700
ニチモウ	100	1,902.00	190,200
極東貿易	100	2,121.00	212,100
イワキ	600	467.00	280,200
三愛石油	1,000	1,174.00	1,174,000
稲畑産業	900	1,458.00	1,312,200
G S Iクレオス	100	1,150.00	115,000
明和産業	400	573.00	229,200
クワザワ	100	614.00	61,400
ワキタ	900	1,141.00	1,026,900
東邦ホールディングス	1,300	2,809.00	3,651,700
サンゲツ	1,100	2,149.00	2,363,900
ミツウロコグループホールディングス	600	1,339.00	803,400
シナネンホールディングス	200	1,985.00	397,000
伊藤忠エネクス	900	902.00	811,800
サンリオ	1,200	2,190.00	2,628,000
サンワテクノス	300	1,126.00	337,800
リョーサン	500	2,885.00	1,442,500
新光商事	700	911.00	637,700
トーホー	200	1,804.00	360,800
三信電気	200	1,620.00	324,000
東陽テクニカ	500	1,179.00	589,500
モスフードサービス	600	2,839.00	1,703,400

加賀電子	400	2,216.00	886,400
ソーダニッカ	400	640.00	256,000
立花エレテック	300	1,772.00	531,600
フォーバル	200	997.00	199,400
PALTAC	700	5,360.00	3,752,000
三谷産業	600	323.00	193,800
太平洋興発	200	835.00	167,000
西本Wismettacホールディングス	100	3,685.00	368,500
国際紙パルプ商事	1,000	329.00	329,000
ヤマタネ	200	1,436.00	287,200
日鉄物産	300	4,765.00	1,429,500
泉州電業	100	2,905.00	290,500
トラスコ中山	900	2,710.00	2,439,000
オートバックスセブン	1,500	1,846.00	2,769,000
モリト	300	809.00	242,700
加藤産業	700	3,575.00	2,502,500
北恵	100	1,109.00	110,900
イノテック	300	964.00	289,200
イエローハット	800	1,950.00	1,560,000
JKホールディングス	400	604.00	241,600
日伝	400	2,078.00	831,200
北沢産業	300	277.00	83,100
杉本商事	200	2,016.00	403,200
因幡電機産業	600	5,100.00	3,060,000
東テク	100	2,455.00	245,500
ミスミグループ本社	5,200	2,850.00	14,820,000
アルテック	300	241.00	72,300
タキヒヨー	100	1,924.00	192,400
蔵王産業	100	1,446.00	144,600
スズケン	1,800	5,650.00	10,170,000
ジェコス	300	943.00	282,900
グローセル	400	446.00	178,400
ローソン	1,100	6,130.00	6,743,000
サンエー	300	5,280.00	1,584,000
カワチ薬品	300	2,299.00	689,700
エービーシー・マート	600	7,560.00	4,536,000
ハードオフコーポレーション	100	817.00	81,700
アスクル	400	2,867.00	1,146,800
ゲオホールディングス	700	1,359.00	951,300
アダストリア	600	2,780.00	1,668,000
ジーフット	200	625.00	125,000
くら寿司	200	4,615.00	923,000

キャンドウ	200	1,605.00	321,000
パルグループホールディングス	200	3,560.00	712,000
エディオン	1,900	1,198.00	2,276,200
サーラコーポレーション	800	648.00	518,400
ワッツ	100	617.00	61,700
ハローズ	100	2,740.00	274,000
フジオフードシステム	200	3,075.00	615,000
あみやき亭	100	3,530.00	353,000
ひらまつ	700	324.00	226,800
大黒天物産	100	3,395.00	339,500
ハニーズホールディングス	400	1,373.00	549,200
ファーマライズホールディングス	100	652.00	65,200
アルペン	300	1,849.00	554,700
ハブ	100	1,029.00	102,900
クオールホールディングス	600	1,614.00	968,400
ジーンズホールディングス	200	6,870.00	1,374,000
ビックカメラ	2,500	1,217.00	3,042,500
D C Mホールディングス	2,200	1,091.00	2,400,200
ペッパーフードサービス	300	1,631.00	489,300
Monotaro	3,000	3,130.00	9,390,000
東京一番フーズ	100	625.00	62,500
D Dホールディングス	200	1,519.00	303,800
きちりホールディングス	100	827.00	82,700
アークランドサービスホールディングス	300	1,953.00	585,900
J . フロント リテイリング	5,000	1,421.00	7,105,000
ドトール・日レスホールディングス	700	2,178.00	1,524,600
マツモトキヨシホールディングス	1,700	4,070.00	6,919,000
ブロンコビリー	200	2,669.00	533,800
Z O Z O	4,100	2,560.00	10,496,000
トレジャー・ファクトリー	100	1,177.00	117,700
物語コーポレーション	100	9,250.00	925,000
ココカラファイン	400	6,410.00	2,564,000
三越伊勢丹ホールディングス	7,300	915.00	6,679,500
H a m e e	100	1,209.00	120,900
ウエルシアホールディングス	1,200	6,500.00	7,800,000
クリエイトSDホールディングス	600	2,799.00	1,679,400
丸善C H I ホールディングス	400	375.00	150,000
ミサワ	100	805.00	80,500
チムニー	100	2,426.00	242,600
シュッピン	300	962.00	288,600
ネクステージ	600	1,123.00	673,800
ジョイフル本田	1,200	1,505.00	1,806,000

鳥貴族	100	2,010.00	201,000
キリン堂ホールディングス	200	2,122.00	424,400
ホットランド	300	1,235.00	370,500
すかいらーくホールディングス	4,700	2,026.00	9,522,200
SFPホールディングス	200	2,292.00	458,400
綿半ホールディングス	100	2,113.00	211,300
ヨシックス	100	3,030.00	303,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,200	987.00	1,184,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	695.00	139,000
B E E N O S	100	1,355.00	135,500
あさひ	300	1,240.00	372,000
日本調剤	100	3,930.00	393,000
コスモス薬品	200	22,570.00	4,514,000
トーエル	200	801.00	160,200
オンリー	100	800.00	80,000
セブン&アイ・ホールディングス	16,300	4,197.00	68,411,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,100	1,842.00	2,026,200
ツルハホールディングス	900	12,560.00	11,304,000
サンマルクホールディングス	300	2,449.00	734,700
フェリシモ	100	1,049.00	104,900
トリドールホールディングス	500	2,451.00	1,225,500
T O K Y O B A S E	300	769.00	230,700
ジャパンミート	200	2,252.00	450,400
アレンザホールディングス	200	838.00	167,600
串カツ田中ホールディングス	100	2,433.00	243,300
パロックジャパンリミテッド	300	931.00	279,300
クスリのアオキホールディングス	400	8,220.00	3,288,000
力の源ホールディングス	200	862.00	172,400
スシローグローバルホールディングス	500	7,640.00	3,820,000
L I X I L ビバ	400	2,024.00	809,600
メディカルシステムネットワーク	400	549.00	219,600
はるやまホールディングス	200	847.00	169,400
ノジマ	700	2,353.00	1,647,100
カッパ・クリエイト	600	1,485.00	891,000
ライトオン	300	573.00	171,900
ジーンズメイト	100	332.00	33,200
良品計画	5,500	2,507.00	13,788,500
三城ホールディングス	300	287.00	86,100
アドヴァン	600	1,243.00	745,800
アルビス	200	2,350.00	470,000
コナカ	400	428.00	171,200

G - 7ホールディングス	100	4,040.00	404,000
イオン北海道	400	806.00	322,400
コジマ	700	436.00	305,200
ヒマラヤ	100	844.00	84,400
コーナン商事	600	2,648.00	1,588,800
エコス	100	1,682.00	168,200
ワタミ	500	1,422.00	711,000
マルシェ	100	779.00	77,900
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	10,000	1,781.00	17,810,000
西松屋チェーン	900	959.00	863,100
ゼンショーホールディングス	2,000	2,420.00	4,840,000
幸楽苑ホールディングス	300	2,030.00	609,000
ハークスレイ	100	1,057.00	105,700
サイゼリヤ	700	2,452.00	1,716,400
V Tホールディングス	1,700	489.00	831,300
魚力	100	1,545.00	154,500
ポブラ	100	525.00	52,500
フジ・コーポレーション	100	2,232.00	223,200
ユナイテッドアローズ	400	3,690.00	1,476,000
ハイデイ日高	600	2,176.00	1,305,600
京都きもの友禅	200	366.00	73,200
コロワイド	1,400	2,182.00	3,054,800
ピーシーデポコーポレーション	500	493.00	246,500
壱番屋	300	5,100.00	1,530,000
トップカルチャー	100	343.00	34,300
P L A N T	100	687.00	68,700
スギホールディングス	800	6,110.00	4,888,000
薬王堂ホールディングス	200	2,709.00	541,800
ヴィア・ホールディングス	500	672.00	336,000
スクロール	600	345.00	207,000
ヨンドシーホールディングス	400	2,627.00	1,050,800
ファミリーマート	3,300	2,787.00	9,197,100
木曽路	500	2,815.00	1,407,500
S R Sホールディングス	500	1,055.00	527,500
千趣会	700	386.00	270,200
タカキュー	200	199.00	39,800
ケーヨー	800	545.00	436,000
上新電機	500	2,312.00	1,156,000
日本瓦斯	700	3,190.00	2,233,000
ロイヤルホールディングス	700	2,529.00	1,770,300
いなげや	500	1,478.00	739,000
島忠	900	3,040.00	2,736,000

チヨダ	400	1,651.00	660,400
ライフコーポレーション	300	2,566.00	769,800
リンガーハット	500	2,457.00	1,228,500
MrMaxHD	500	496.00	248,000
テンアライド	300	446.00	133,800
AOKIホールディングス	800	1,163.00	930,400
オークワ	600	1,391.00	834,600
コメリ	600	2,389.00	1,433,400
青山商事	900	1,949.00	1,754,100
しまむら	500	9,520.00	4,760,000
はせがわ	200	407.00	81,400
高島屋	3,000	1,317.00	3,951,000
松屋	800	872.00	697,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,000	1,257.00	2,514,000
近鉄百貨店	200	3,500.00	700,000
パルコ	400	1,328.00	531,200
丸井グループ	3,800	2,478.00	9,416,400
アクシアル リテイリング	300	4,080.00	1,224,000
井筒屋	200	247.00	49,400
イオン	16,000	2,275.00	36,400,000
イズミ	800	4,270.00	3,416,000
平和堂	800	2,144.00	1,715,200
フジ	500	1,996.00	998,000
ヤオコー	500	5,250.00	2,625,000
ゼビオホールディングス	500	1,264.00	632,000
ケーズホールディングス	4,000	1,246.00	4,984,000
Olympicグループ	200	611.00	122,200
日産東京販売ホールディングス	500	305.00	152,500
Genky DrugStores	200	2,489.00	497,800
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,224.00	122,400
総合メディカルホールディングス	400	1,932.00	772,800
ブックオフグループホールディングス	200	1,152.00	230,400
アインホールディングス	600	6,600.00	3,960,000
元気寿司	100	2,989.00	298,900
ヤマダ電機	12,600	546.00	6,879,600
アークランドサカモト	600	1,323.00	793,800
ニトリホールディングス	1,800	16,785.00	30,213,000
グルメ杵屋	300	1,195.00	358,500
愛眼	200	259.00	51,800
ケーユーホールディングス	200	932.00	186,400
吉野家ホールディングス	1,400	2,643.00	3,700,200
松屋フーズホールディングス	200	4,200.00	840,000

サガミホールディングス	500	1,398.00	699,000	
関西スーパーマーケット	300	1,068.00	320,400	
王将フードサービス	300	6,510.00	1,953,000	
プレナス	500	1,890.00	945,000	
ミニストップ	300	1,519.00	455,700	
アークス	800	2,341.00	1,872,800	
パローホールディングス	900	1,977.00	1,779,300	
ベルク	200	5,290.00	1,058,000	
大庄	200	1,595.00	319,000	
ファーストリテイリング	600	69,110.00	41,466,000	
サンドラッグ	1,600	3,715.00	5,944,000	
サクスパー ホールディングス	300	932.00	279,600	
ヤマザワ	100	1,692.00	169,200	
やまや	100	2,157.00	215,700	
ペルーナ	900	742.00	667,800	
島根銀行	100	728.00	72,800	
じもとホールディングス	2,800	106.00	296,800	
めぶきフィナンシャルグループ	21,700	286.00	6,206,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	600	1,533.00	919,800	
九州フィナンシャルグループ	6,800	455.00	3,094,000	
ゆうちょ銀行	11,800	1,080.00	12,744,000	
富山第一銀行	1,000	341.00	341,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	24,500	456.00	11,172,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	2,800	871.00	2,438,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	2,400	748.00	1,795,200	
三十三フィナンシャルグループ	400	1,686.00	674,400	
第四北越フィナンシャルグループ	700	2,839.00	1,987,300	
新生銀行	3,100	1,774.00	5,499,400	
あおぞら銀行	2,500	2,804.00	7,010,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	287,200	581.40	166,978,080	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	45,800	481.40	22,048,120	
三井住友トラスト・ホールディングス	7,900	4,108.00	32,453,200	
三井住友フィナンシャルグループ	28,900	3,960.00	114,444,000	代用有価証券 3,500株
千葉銀行	14,300	611.00	8,737,300	
群馬銀行	8,200	375.00	3,075,000	
武蔵野銀行	600	1,965.00	1,179,000	
千葉興業銀行	1,100	332.00	365,200	
筑波銀行	1,700	228.00	387,600	
七十七銀行	1,400	1,760.00	2,464,000	
青森銀行	300	2,945.00	883,500	
秋田銀行	300	2,255.00	676,500	

山形銀行	500	1,575.00	787,500	
岩手銀行	300	2,874.00	862,200	
東邦銀行	3,700	275.00	1,017,500	
東北銀行	200	1,022.00	204,400	
みちのく銀行	300	1,652.00	495,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	3,500	2,126.00	7,441,000	
静岡銀行	10,300	847.00	8,724,100	
十六銀行	500	2,626.00	1,313,000	
スルガ銀行	4,300	468.00	2,012,400	
八十二銀行	10,000	485.00	4,850,000	
山梨中央銀行	500	1,129.00	564,500	
大垣共立銀行	800	2,676.00	2,140,800	
福井銀行	400	1,623.00	649,200	
北國銀行	400	3,275.00	1,310,000	
清水銀行	200	1,954.00	390,800	
富山銀行	100	2,666.00	266,600	
滋賀銀行	800	2,670.00	2,136,000	
南都銀行	700	2,822.00	1,975,400	
百五銀行	3,800	358.00	1,360,400	
京都銀行	1,500	4,475.00	6,712,500	
紀陽銀行	1,500	1,721.00	2,581,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	2,800	1,126.00	3,152,800	
広島銀行	6,100	567.00	3,458,700	
山陰合同銀行	2,500	659.00	1,647,500	
中国銀行	3,600	1,098.00	3,952,800	
鳥取銀行	100	1,418.00	141,800	
伊予銀行	5,900	591.00	3,486,900	
百十四銀行	400	2,283.00	913,200	
四国銀行	600	1,032.00	619,200	
阿波銀行	700	2,640.00	1,848,000	
大分銀行	200	3,050.00	610,000	
宮崎銀行	300	2,788.00	836,400	
佐賀銀行	300	1,660.00	498,000	
沖縄銀行	400	3,855.00	1,542,000	
琉球銀行	1,000	1,217.00	1,217,000	
セブン銀行	13,900	323.00	4,489,700	
みずほフィナンシャルグループ	567,000	171.00	96,957,000	代用有価証券 71,500株
高知銀行	100	844.00	84,400	
山口フィナンシャルグループ	5,200	787.00	4,092,400	
長野銀行	100	1,658.00	165,800	
名古屋銀行	300	3,290.00	987,000	
北洋銀行	6,400	245.00	1,568,000	

愛知銀行	100	3,770.00	377,000
中京銀行	200	2,230.00	446,000
大光銀行	100	1,830.00	183,000
愛媛銀行	600	1,160.00	696,000
トマト銀行	200	1,096.00	219,200
京葉銀行	1,800	693.00	1,247,400
栃木銀行	2,000	233.00	466,000
北日本銀行	100	1,990.00	199,000
東和銀行	700	954.00	667,800
福島銀行	400	245.00	98,000
大東銀行	200	610.00	122,000
トモニホールディングス	3,200	386.00	1,235,200
フィデアホールディングス	4,000	135.00	540,000
池田泉州ホールディングス	4,800	203.00	974,400
F P G	1,300	1,196.00	1,554,800
マーキュリアインベストメント	200	764.00	152,800
S B Iホールディングス	4,700	2,405.00	11,303,500
日本アジア投資	300	306.00	91,800
ジャフコ	600	4,180.00	2,508,000
大和証券グループ本社	33,500	511.60	17,138,600
野村ホールディングス	73,500	517.20	38,014,200
岡三証券グループ	3,600	395.00	1,422,000
丸三証券	1,200	532.00	638,400
東洋証券	1,500	169.00	253,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,800	314.00	1,507,200
光世証券	100	679.00	67,900
水戸証券	1,200	256.00	307,200
いちよし証券	800	708.00	566,400
松井証券	2,400	910.00	2,184,000
だいこう証券ビジネス	200	586.00	117,200
マネックスグループ	3,200	278.00	889,600
極東証券	600	816.00	489,600
岩井コスモホールディングス	400	1,205.00	482,000
藍澤証券	700	750.00	525,000
マネーパートナーズグループ	400	255.00	102,000
スパークス・グループ	1,400	246.00	344,400
小林洋行	100	253.00	25,300
かんぽ生命保険	1,500	1,755.00	2,632,500
S O M P Oホールディングス	7,900	4,400.00	34,760,000
アニコム ホールディングス	300	3,915.00	1,174,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	10,900	3,563.00	38,836,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,400	2,404.00	8,173,600

第一生命ホールディングス	23,600	1,847.00	43,589,200
東京海上ホールディングス	14,900	5,888.00	87,731,200
T & Dホールディングス	12,900	1,297.00	16,731,300
アドバンスクリエイト	100	1,970.00	197,000
全国保証	1,200	4,385.00	5,262,000
ジェイリース	200	334.00	66,800
イントラスト	100	750.00	75,000
日本モーゲージサービス	100	1,400.00	140,000
C a s a	100	1,257.00	125,700
アルヒ	700	2,576.00	1,803,200
プレミアグループ	200	1,952.00	390,400
クレディセゾン	2,900	1,648.00	4,779,200
芙蓉総合リース	400	7,330.00	2,932,000
みずほリース	600	3,245.00	1,947,000
東京センチュリー	800	5,460.00	4,368,000
日本証券金融	1,900	533.00	1,012,700
アイフル	6,400	252.00	1,612,800
リコーリース	300	3,780.00	1,134,000
イオンフィナンシャルサービス	2,600	1,670.00	4,342,000
アコム	8,400	428.00	3,595,200
ジャックス	500	2,511.00	1,255,500
オリエントコーポレーション	11,400	155.00	1,767,000
日立キャピタル	1,000	2,531.00	2,531,000
アプラスフィナンシャル	2,100	98.00	205,800
オリックス	26,100	1,742.00	45,466,200
三菱UFJリース	10,600	688.00	7,292,800
九州リースサービス	200	608.00	121,600
日本取引所グループ	12,000	1,879.00	22,548,000
イー・ギャランティ	500	1,450.00	725,000
アサックス	200	641.00	128,200
NECキャピタルソリューション	200	2,358.00	471,600
いちご	5,300	434.00	2,300,200
日本駐車場開発	4,700	163.00	766,100
スター・マイカ・ホールディングス	200	1,957.00	391,400
ヒューリック	8,900	1,180.00	10,502,000
三栄建築設計	200	1,563.00	312,600
野村不動産ホールディングス	2,500	2,578.00	6,445,000
三重交通グループホールディングス	900	623.00	560,700
サムティ	600	2,144.00	1,286,400
ディア・ライフ	600	510.00	306,000
コーセーアールイー	100	804.00	80,400
エー・ディー・ワークス	8,300	31.00	257,300

日本商業開発	300	1,541.00	462,300
プレサンスコーポレーション	700	1,796.00	1,257,200
ユニゾホールディングス	600	5,090.00	3,054,000
THEグローバル社	200	475.00	95,000
ハウスコム	100	1,619.00	161,900
日本管理センター	300	1,416.00	424,800
サンセイランディック	100	935.00	93,500
エストラスト	100	805.00	80,500
フージャースホールディングス	800	679.00	543,200
オープンハウス	1,200	2,828.00	3,393,600
東急不動産ホールディングス	11,400	734.00	8,367,600
飯田グループホールディングス	3,500	1,840.00	6,440,000
イーランド	100	780.00	78,000
ムゲンエステート	300	682.00	204,600
ビーロッド	100	2,006.00	200,600
ファーストブラザーズ	100	1,269.00	126,900
ハウストゥ	200	1,691.00	338,200
シーアールイー	100	1,068.00	106,800
プロパティエージェント	100	1,167.00	116,700
ケイアイスター不動産	100	1,955.00	195,500
アグレ都市デザイン	100	507.00	50,700
グッドコムアセット	100	1,733.00	173,300
グローバル・リンク・マネジメント	100	662.00	66,200
パーク24	2,200	2,570.00	5,654,000
パラカ	100	2,039.00	203,900
三井不動産	20,800	2,835.50	58,978,400
三菱地所	29,200	2,116.50	61,801,800
平和不動産	800	2,630.00	2,104,000
東京建物	4,600	1,557.00	7,162,200
ダイビル	1,100	1,179.00	1,296,900
京阪神ビルディング	700	1,342.00	939,400
住友不動産	9,400	3,952.00	37,148,800
テオーシー	800	844.00	675,200
東京楽天地	100	6,000.00	600,000
レオパレス21	5,500	282.00	1,551,000
スターツコーポレーション	600	2,789.00	1,673,400
フジ住宅	500	717.00	358,500
空港施設	400	575.00	230,000
明和地所	200	587.00	117,400
ゴールドクレスト	300	2,300.00	690,000
エスリード	200	2,098.00	419,600
日神不動産	600	515.00	309,000

日本エスコン	800	907.00	725,600
タカラレーベン	2,000	482.00	964,000
サンヨーハウジング名古屋	300	969.00	290,700
イオンモール	2,100	1,756.00	3,687,600
毎日コムネット	100	818.00	81,800
ファースト住建	200	1,325.00	265,000
カチタス	500	4,730.00	2,365,000
トーセイ	600	1,420.00	852,000
サンフロンティア不動産	600	1,331.00	798,600
エフ・ジェー・ネクスト	400	1,070.00	428,000
インテリックス	100	751.00	75,100
ランドビジネス	200	774.00	154,800
日本社宅サービス	100	1,116.00	111,600
グランディハウス	300	496.00	148,800
日本空港ビルデング	1,300	5,380.00	6,994,000
日本工営	300	3,540.00	1,062,000
L I F U L L	1,400	669.00	936,600
ジェイエイシーリクルートメント	300	2,042.00	612,600
日本M&Aセンター	3,100	3,410.00	10,571,000
メンバーズ	100	2,484.00	248,400
アイティメディア	100	801.00	80,100
タケエイ	400	1,276.00	510,400
トラスト・テック	400	1,391.00	556,400
コシダカホールディングス	1,000	1,553.00	1,553,000
アルトナー	100	750.00	75,000
パソナグループ	500	1,522.00	761,000
C D S	100	1,418.00	141,800
リンクアンドモチベーション	900	599.00	539,100
G C A	500	883.00	441,500
エス・エム・エス	1,300	2,829.00	3,677,700
サニーサイドアップ	100	965.00	96,500
パーソルホールディングス	4,000	2,133.00	8,532,000
リニカル	200	977.00	195,400
クックパッド	1,400	327.00	457,800
エスクリ	100	866.00	86,600
アイ・ケイ・ケイ	200	701.00	140,200
学情	100	1,475.00	147,500
スタジオアリス	200	1,924.00	384,800
シミックホールディングス	200	1,853.00	370,600
エプコ	100	1,404.00	140,400
N J S	100	1,698.00	169,800
総合警備保障	1,600	5,720.00	9,152,000

カカココム	3,000	2,395.00	7,185,000
アイロムグループ	100	1,519.00	151,900
セントケア・ホールディング	300	520.00	156,000
サイネックス	100	698.00	69,800
ルネサンス	200	1,732.00	346,400
ディップ	600	3,095.00	1,857,000
オプトホールディング	200	1,700.00	340,000
新日本科学	400	621.00	248,400
ツクイ	900	450.00	405,000
キャリアデザインセンター	100	1,440.00	144,000
ベネフィット・ワン	1,100	1,971.00	2,168,100
エムスリー	8,900	2,653.00	23,611,700
ツカダ・グローバルホールディング	200	608.00	121,600
プラス	100	664.00	66,400
アウトソーシング	2,300	1,178.00	2,709,400
ウェルネット	400	848.00	339,200
ワールドホールディングス	100	1,794.00	179,400
ディー・エヌ・エー	2,000	1,779.00	3,558,000
博報堂D Yホールディングス	5,600	1,687.00	9,447,200
ぐるなび	700	982.00	687,400
タカミヤ	400	697.00	278,800
ジャパンベストレスキューシステム	300	1,070.00	321,000
ファンコミュニケーションズ	1,100	508.00	558,800
ライク	200	1,722.00	344,400
ビジネス・ブレークスルー	200	357.00	71,400
エスプール	800	665.00	532,000
WDBホールディングス	200	2,760.00	552,000
ティア	200	611.00	122,200
バリューコマース	200	1,647.00	329,400
インフォマート	2,200	1,832.00	4,030,400
J Pホールディングス	1,300	299.00	388,700
エコナックホールディングス	700	142.00	99,400
E P Sホールディングス	600	1,355.00	813,000
レッグス	100	1,382.00	138,200
プレステージ・インターナショナル	1,500	876.00	1,314,000
アミューズ	200	2,900.00	580,000
ドリームインキュベータ	100	1,644.00	164,400
クイック	300	1,622.00	486,600
T A C	300	230.00	69,000
ケネディクス	3,800	593.00	2,253,400
電通	4,200	4,020.00	16,884,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	1,240.00	248,000

ぴあ	100	4,870.00	487,000
イオンファンタジー	200	2,983.00	596,600
シーティーエス	500	737.00	368,500
ネクシィーズグループ	100	2,170.00	217,000
みらかホールディングス	1,100	2,667.00	2,933,700
アルプス技研	400	1,643.00	657,200
サニックス	700	380.00	266,000
ダイオーズ	100	1,320.00	132,000
日本空調サービス	400	722.00	288,800
オリエンタルランド	4,300	15,610.00	67,123,000
ダスキン	1,000	2,918.00	2,918,000
明光ネットワークジャパン	500	980.00	490,000
ファルコホールディングス	200	1,765.00	353,000
秀英予備校	100	436.00	43,600
田谷	100	604.00	60,400
ラウンドワン	1,100	1,419.00	1,560,900
リゾートトラスト	1,800	1,751.00	3,151,800
ビー・エム・エル	500	3,160.00	1,580,000
ワタベウェディング	100	600.00	60,000
りらいあコミュニケーションズ	700	1,443.00	1,010,100
リソー教育	1,900	416.00	790,400
早稲田アカデミー	100	946.00	94,600
ユー・エス・エス	4,500	2,042.00	9,189,000
東京個別指導学院	100	798.00	79,800
サイバーエージェント	2,300	3,685.00	8,475,500
楽天	18,900	1,066.00	20,147,400
クリーク・アンド・リバー社	200	1,148.00	229,600
テー・オー・ダブリュー	400	789.00	315,600
山田コンサルティンググループ	200	2,040.00	408,000
セントラルスポーツ	100	3,350.00	335,000
フルキャストホールディングス	400	2,259.00	903,600
エン・ジャパン	700	5,030.00	3,521,000
テクノプロ・ホールディングス	800	6,900.00	5,520,000
アトラ	100	382.00	38,200
インターワークス	100	513.00	51,300
アイ・アールジャパンホールディングス	200	3,735.00	747,000
K e e P e r 技研	200	1,509.00	301,800
ファーストロジック	100	658.00	65,800
三機サービス	100	980.00	98,000
G u n o s y	300	1,694.00	508,200
デザインワン・ジャパン	100	313.00	31,300
イー・ガーディアン	200	1,793.00	358,600

リブセンス	200	360.00	72,000
ジャパンマテリアル	1,200	1,554.00	1,864,800
ベクトル	500	989.00	494,500
ウチヤマホールディングス	200	526.00	105,200
チャーム・ケア・コーポレーション	100	2,108.00	210,800
ライクキッズ	100	901.00	90,100
キャリアリンク	100	581.00	58,100
I B J	300	944.00	283,200
アサンテ	200	2,059.00	411,800
N・フィールド	300	653.00	195,900
バリューHR	100	3,245.00	324,500
M&Aキャピタルパートナーズ	100	8,190.00	819,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	200	1,337.00	267,400
E R Iホールディングス	100	793.00	79,300
アビスト	100	2,668.00	266,800
シグマクシス	300	1,901.00	570,300
ウィルグループ	300	1,019.00	305,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	500	228.00	114,000
リクルートホールディングス	29,000	3,724.00	107,996,000
エラン	200	1,757.00	351,400
土木管理総合試験所	200	462.00	92,400
ネットマーケティング	100	963.00	96,300
日本郵政	33,200	1,011.50	33,581,800
ベルシステム24ホールディングス	700	1,700.00	1,190,000
鎌倉新書	300	1,518.00	455,400
S M N	100	942.00	94,200
L I T A L I C O	100	2,224.00	222,400
グローバルキッズCOMPANY	100	866.00	86,600
エボラブルアジア	200	1,928.00	385,600
アトラエ	100	3,225.00	322,500
ストライク	200	4,240.00	848,000
ソラスト	1,100	1,271.00	1,398,100
セラク	100	753.00	75,300
インソース	200	2,925.00	585,000
ベイカレント・コンサルティング	200	5,440.00	1,088,000
Orchestra Holdings	100	1,069.00	106,900
アイモバイル	100	668.00	66,800
キャリアインデックス	200	448.00	89,600
MS - J a p a n	100	1,339.00	133,900
船場	100	1,014.00	101,400
グレイステクノロジー	200	3,060.00	612,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	400	2,987.00	1,194,800

フルテック	100	1,392.00	139,200
グリーンズ	200	1,255.00	251,000
ツナググループ・ホールディングス	100	593.00	59,300
GameWith	100	854.00	85,400
ソウルドアウト	100	1,383.00	138,300
MS&Consulting	100	1,025.00	102,500
日総工産	300	1,186.00	355,800
キュービーネットホールディングス	200	2,313.00	462,600
RPAホールディングス	200	1,268.00	253,600
スプリックス	100	1,552.00	155,200
アドバンテッジリスクマネジメント	200	942.00	188,400
リログループ	2,200	2,662.00	5,856,400
東祥	300	2,343.00	702,900
エイチ・アイ・エス	600	2,861.00	1,716,600
ラックランド	100	2,463.00	246,300
共立メンテナンス	700	4,880.00	3,416,000
イチネンホールディングス	500	1,447.00	723,500
建設技術研究所	300	1,919.00	575,700
スペース	300	1,271.00	381,300
長大	100	1,279.00	127,900
燦ホールディングス	200	1,171.00	234,200
東京テアトル	200	1,413.00	282,600
タナベ経営	100	1,243.00	124,300
ナガワ	100	7,170.00	717,000
よみうりランド	100	4,660.00	466,000
東京都競馬	300	3,330.00	999,000
常磐興産	200	1,759.00	351,800
カナモト	700	2,967.00	2,076,900
東京ドーム	1,600	977.00	1,563,200
西尾レントオール	400	2,973.00	1,189,200
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	2,400	34.00	81,600
トランス・コスモス	400	2,933.00	1,173,200
乃村工藝社	1,700	1,365.00	2,320,500
藤田観光	200	2,947.00	589,400
KNT-CTホールディングス	300	1,503.00	450,900
日本管財	400	1,928.00	771,200
トーカイ	400	2,651.00	1,060,400
セコム	4,300	9,611.00	41,327,300
セントラル警備保障	200	6,080.00	1,216,000
丹青社	800	1,163.00	930,400
メイテック	500	5,740.00	2,870,000
応用地質	400	1,245.00	498,000

船井総研ホールディングス	800	2,692.00	2,153,600	
進学会ホールディングス	100	551.00	55,100	
オオバ	300	770.00	231,000	
いであ	100	1,900.00	190,000	
学究社	100	1,291.00	129,100	
ベネッセホールディングス	1,300	3,015.00	3,919,500	
イオンディライト	500	3,775.00	1,887,500	
ナック	200	1,065.00	213,000	
ニチイ学館	600	1,903.00	1,141,800	
ダイセキ	700	3,105.00	2,173,500	
ステップ	200	1,491.00	298,200	
合 計	4,939,600		10,141,204,820	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年11月29日現在です。

【インデックスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	10,036,321,756円
負債総額	12,141,057円
純資産総額（ - ）	10,024,180,699円
発行済口数	13,926,124,293口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7198円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	216,562,556円
負債総額	218,899円
純資産総額（ - ）	216,343,657円
発行済口数	226,335,455口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9559円

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	10,127,046,503円
負債総額	2,827,030円
純資産総額（ - ）	10,124,219,473円
発行済口数	5,803,914,435口
1口当たり純資産額（ / ）	1.744円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（４）受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

（５）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2019年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2019年11月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2019年11月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2019年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	832	202,219
株式投資信託	784	172,232
単位型	259	8,949
追加型	525	163,282
公社債投資信託	48	29,987
単位型	34	910
追加型	14	29,076

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3	14,024
有価証券		3
前払費用		14,024
未収入金		19
未収委託者報酬		551
未収収益	3	73
関係会社短期貸付金		15,873
立替金		3,174
その他	2,3	3
流動資産合計		41,800
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	68
器具備品	1	122
有形固定資産合計		191
無形固定資産		
ソフトウェア		99

無形固定資産合計	99	107
投資その他の資産		
投資有価証券	14,103	16,755
関係会社株式	25,769	25,769
長期差入保証金	490	447
長期前払費用	0	-
繰延税金資産	1,504	1,913
投資その他の資産合計	41,868	44,886
固定資産合計	42,159	45,268
資産合計	83,959	88,038

(単位：百万円)

	第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	3	3,804		354
未払金		5,874		6,112
未払収益分配金		7		7
未払償還金		91		71
未払手数料	3	5,124	3	5,299
その他未払金		651		734
未払費用	3	4,634	3	3,897
未払法人税等		2,185		2,382
未払消費税等	4	788	4	621
賞与引当金		2,286		2,680
役員賞与引当金		198		210
その他		41	3	172
流動負債合計		19,813		16,431
固定負債				
退職給付引当金		1,316		1,405
その他		318		629
固定負債合計		1,634		2,035
負債合計		21,448		18,466
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		39,959		47,142
利益剰余金合計		39,959		47,142
自己株式		786		833
株主資本合計		61,756		68,891
評価・換算差額等				

その他有価証券評価差額金	408	493
繰延ヘッジ損益	346	185
評価・換算差額等合計	754	679
純資産合計	62,511	69,571
負債純資産合計	83,959	88,038

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,609	77,264
その他営業収益	5,398	3,063
営業収益合計	76,008	80,328
営業費用		
支払手数料	30,448	32,834
広告宣伝費	973	960
公告費	2	2
調査費	18,132	18,251
調査費	862	890
委託調査費	17,241	17,333
図書費	28	27
委託計算費	520	541
営業雑経費	740	794
通信費	173	128
印刷費	348	334
協会費	68	69
諸会費	24	19
その他	125	243
営業費用計	50,817	53,385
一般管理費		
給料	9,096	9,783
役員報酬	507	241
役員賞与引当金繰入額	198	210
給料・手当	6,083	6,589
賞与	20	61
賞与引当金繰入額	2,286	2,680
交際費	99	92
寄付金	16	13
旅費交通費	455	476
租税公課	424	428
不動産賃借料	890	888
退職給付費用	355	378
退職金	24	52
固定資産減価償却費	152	108
福利費	974	1,071
諸経費	3,175	3,106
一般管理費計	15,664	16,401
営業利益	9,526	10,540

(単位：百万円)

	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
	営業外収益			
受取利息		26		37
受取配当金	1	1,120	1	1,865
有価証券償還益		1		1
デリバティブ収益		-	1	142
時効成立分配金・償還金		1		21
為替差益		79		58
その他		41		48
営業外収益合計		1,272		2,176
営業外費用				
支払利息	1	223	1	286
デリバティブ費用	1	295		-
時効成立後支払分配金・償還金		0		78
長期差入保証金償却額		212		-
その他		34		24
営業外費用合計		767		388
経常利益		10,030		12,328
特別利益				
投資有価証券売却益		199		218
特別利益合計		199		218
特別損失				
投資有価証券売却損		133		176
固定資産処分損		7		0
役員退職一時金		117		180
損害賠償損失		81		-
特別損失合計		340		357
税引前当期純利益		9,890		12,189
法人税、住民税及び事業税		3,217		3,741
法人税等調整額		307		375
法人税等合計		2,910		3,366
当期純利益		6,979		8,823

(3) 【株主資本等変動計算書】

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						113	113

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	5,943	5,943	113	5,830
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額等 合計	
当期首残高	282	266	548	56,475
当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							
剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	7,182	7,182	47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85	160	75	75

当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	4年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生 of 翌事業年度から費用処理しております。</p>				

4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(未適用の会計基準等)

- 「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- 「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
- ステップ2：契約における履行義務を識別する。
- ステップ3：取引価格を算定する。
- ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
- ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
<p>(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)</p> <p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。</p> <p>この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」1,014百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,504百万円に含めて表示しております。</p>	

(貸借対照表関係)

第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1,260百万円	1,281百万円
	建物	612百万円	655百万円
	器具備品		

<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 3,189百万円 未収収益 592百万円 その他 345百万円 (流動負債) 預り金 419百万円 未払手数料 376百万円 未払費用 677百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 1,347百万円 未収収益 127百万円 (流動負債) 未払手数料 350百万円 未払費用 767百万円 その他 162百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

(損益計算書関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)												
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">979百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">407百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">213百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	979百万円	デリバティブ収益	407百万円	支払利息	213百万円	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,831百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">54百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">75百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	1,831百万円	デリバティブ収益	54百万円	支払利息	75百万円
受取配当金	979百万円												
デリバティブ収益	407百万円												
支払利息	213百万円												
受取配当金	1,831百万円												
デリバティブ収益	54百万円												
支払利息	75百万円												

(株主資本等変動計算書関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,119,100	182,600	-	1,301,700

3 新株予約権等に関する事項

	新株予約権の目的となる株式の数(株)
--	--------------------

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	当事業年 度末残高 (百万円)
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

- (注) 1 2016年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
3 2009年度ストックオプション(1)1,494,900株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)及び2016年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年5月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	2017年3月31日	2017年6月22日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,301,700	64,000	-	1,365,700

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-

2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

- (注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
 3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

(リース取引関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	866百万円	1年内	853百万円
1年超	923百万円	1年超	6,704百万円
合計	1,790百万円	合計	7,558百万円

(金融商品関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主

に自己で設定した投資信託へのシ - ドマネ - の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

営業債務である未払金(未払手数料)、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日でありませぬ。未払金(未払手数料)については、債権(未収委託者報酬)を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりませぬ。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ - ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性(最低限必要な運転資金)を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりませぬ。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-

(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち8百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金及び借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額

(1) 現金・預金	20,680	20,680	-
(2) 未収委託者報酬	16,867	16,867	-
(3) 未収収益	618	618	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,408	2,408	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	16,740	16,740	-
(6) 未払金	(6,112)	(6,112)	-
(7) 未払費用	(3,897)	(3,897)	-
(8) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(31)	(31)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(127)	(127)	-
デリバティブ取引計	(158)	(158)	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万円は流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	20,680	-	-	-
未収委託者報酬	16,867	-	-	-
未収収益	618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363

(有価証券関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	8,544	7,535	1,008
	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420
合計		14,106	13,518	588

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900

貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,422	-	14	14
	買建	-	-	-	-
合計		2,422	-	14	14

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポール ドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
	ユーロ		154	-	6
合計			9,192	-	336

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第60期(2019年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,407	-	3	3
	買建	-	-	-	-
合計		2,407	-	3	3

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	1,792	-	35	35
合計		1,792	-	35	35

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル		975	-	18
	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
ユーロ	81	-	0		
合計			6,040	-	127

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)		関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,008	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,409	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,668
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,827	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,704

(退職給付関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,313
未積立退職給付債務	1,313
未認識数理計算上の差異	2
貸借対照表に計上された負債の額	1,316
退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	0
確定給付制度に係る退職給付費用	132

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,411

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左

対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 4,409,000株
付与日	2017年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況 ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、「当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左

権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左
--------	------------------------------	----

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日

権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,686,200	3,618,000
付与	0	0
失効	630,300	0
権利確定	0	0
権利未確定残	2,055,900	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,877,000	-
付与	0	4,422,000
失効	66,000	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	3,811,000	4,356,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 2,128百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 700	賞与引当金 820
投資有価証券評価損 96	投資有価証券評価損 96
関係会社株式評価損 1,430	関係会社株式評価損 1,430
退職給付引当金 402	退職給付引当金 430
固定資産減価償却費 111	固定資産減価償却費 103
その他 526	その他 761
繰延税金資産小計 3,268	繰延税金資産小計 3,643
評価性引当金 1,430	評価性引当金 1,430
繰延税金資産合計 1,838	繰延税金資産合計 2,212
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 180	その他有価証券評価差額金 217
繰延ヘッジ利益 152	繰延ヘッジ利益 81
繰延税金負債合計 333	繰延税金負債合計 299
繰延税金資産の純額 1,504	繰延税金資産の純額 1,913

<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に参入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">4.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">27.6%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.6%	交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%	受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%	その他	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%
法定実効税率 (調整)	30.6%										
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%										
受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%										
その他	0.6%										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%										

(関連当事者情報)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル 貸建) (注1)	159 (SGD 2,000千) (注2)	関係会社 短期 貸付金	550 (SGD 6,800千)
							貸付金利息 (シンガポールドル 貸建) (注1)	13 (SGD 162千)	未収収益	8 (SGD 110千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	12	未収収益	3
						-	増資の引受 (注4)	2,466 (SGD 30,369千)	-	-
子会社	日本インステイテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受 (注5)	100	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)であります。

- 3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 Nikko Asset Management International Limitedの行った30,369,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 5 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2017年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円

営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付の返済 (シンガポールドル貨建) (注1)	554 (SGD 6,800 千) (注2)	-	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル貨建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期貸付金	1,830 (USD 16,500 千)

							貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注3)	17 (USD 209千)	未収収益	17 (USD 209千)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注5)	アセット マネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,021 (USD 9,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD千) (注5)	アセット マネジメント業	間接 100.00	資金の 借入	資金の借入 (米国ドル 貨建) (注6)	5,364 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貨建) (注6)	5,526 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貨建) (注6)	65 (USD 593千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 取引金額554百万円 (SGD6,800千) の内訳は、貸付の返済554百万円 (SGD6,800千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円 (若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 取引金額1,807百万円 (USD16,500千) の内訳は、貸付1,807百万円 (USD16,500千) であります。
- 5 Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 6 借入枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 7 取引金額5,364百万円 (USD50,000千) 及び5,526百万円 (USD50,000千) の内訳は、借入5,364百万円 (USD50,000千) 及び借入の返済5,526百万円 (USD50,000千) であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)
三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2018年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

資産合計 26,768百万円
負債合計 5,586百万円

純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	319円40銭	355円59銭
1株当たり当期純利益金額	35円64銭	45円08銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,794	195,677
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,494,900株、2009年度ストックオプション(2) 108,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,686,200株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,877,000株	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	62,511	69,571

純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	62,511	69,571
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,711	195,647

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		23,147
有価証券		10
未収委託者報酬		13,391
未収収益		845
関係会社短期貸付金		2,358
その他	2	2,563
流動資産合計		42,316
固定資産		
有形固定資産	1	268
無形固定資産		83
投資その他の資産		
投資有価証券		17,535
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		498
繰延税金資産		1,879
投資その他の資産合計		45,684
固定資産合計		46,036
資産合計		88,353

(単位:百万円)

		第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,950
未払費用		3,948
未払法人税等		1,788
未払消費税等	3	415
賞与引当金		1,432
役員賞与引当金		27
その他		559
流動負債合計		14,122

固定負債		
退職給付引当金		1,433
その他		494
固定負債合計		1,927
負債合計		16,050
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		49,870
利益剰余金合計		49,870
自己株式		905
株主資本合計		71,547
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		356
繰延ヘッジ損益		398
評価・換算差額等合計		755
純資産合計		72,302
負債純資産合計		88,353

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		37,324
その他営業収益		1,394
営業収益合計		38,718
営業費用及び一般管理費	1	33,922
営業利益		4,796
営業外収益	2	2,859
営業外費用	3	124
経常利益		7,530
特別利益	4	126
特別損失	5	4
税引前中間純利益		7,651
法人税等	6	1,711
中間純利益		5,940

(3) 中間株主資本等変動計算書

第61期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当中間期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
中間純利益				5,940	5,940		5,940
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,727	2,727	71	2,655
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	49,870	49,870	905	71,547

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,212
中間純利益				5,940
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	136	212	75	75
当中間期変動額合計	136	212	75	2,731
当中間期末残高	356	398	755	72,302

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>

2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p style="padding-left: 40px;">退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p style="padding-left: 40px;">数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第61期中間会計期間 (2019年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,977百万円
2 信託資産	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4 保証債務	当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務396百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	40百万円
無形固定資産	18百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	51百万円
受取配当金	2,711百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	91百万円
デリバティブ費用	2百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	126百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	4百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2009年度ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	442,200	1,613,700	-
2016年度ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	1,533,000	2,085,000	-
2016年度ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,018,000	2,793,000	-
2017年度ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,018,000	3,338,000	-
合計		15,088,300	-	5,258,600	9,829,700	-

(注) 1 2009年度ストックオプション(1)、2009年度ストックオプション(2)、2011年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、2016年度ストックオプション(1)1,251,000株及び2016年度ストックオプション(2)937,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)834,000株、2016年度ストックオプション(2)1,856,000株及び2017年度ストックオプション(1)3,338,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日取締役会	普通株式	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	898百万円
1年超	6,604百万円
合計	7,503百万円

(金融商品関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	23,147	23,147	-
(2) 未収委託者報酬	13,391	13,391	-
(3) 未収収益	845	845	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,358	2,358	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	17,529	17,529	-
(6) 未払金	(5,950)	(5,950)	-
(7) 未払費用	(3,948)	(3,948)	-
(8) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(64)	(64)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	75	75	-
デリバティブ取引計	11	11	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものは、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているもののうち86百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、10百万円は、流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(中間貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額

中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	投資信託	12,130	11,325	805
	小計	12,130	11,325	805
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	投資信託	5,399	5,690	291
	小計	5,399	5,690	291
合計		17,529	17,015	513

- (注) 1 減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当中間会計期間については、該当ございません。
- 2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,129	-	47	47
合計		2,129	-	47	47

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,760	-	17	17
合計		1,760	-	17	17

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		2,261	-	10
	豪ドル		71	-	2
	シンガポールドル		913	-	11

	ユーロ		72	-	2
	香港ドル		425	-	1
	人民元		2,091	-	68
合計			5,834	-	75

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,004百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,509百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,047百万円

(ストックオプション等関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

[関連情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負のれん発生益に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1株当たり純資産額	369円72銭
1株当たり中間純利益金額	30円36銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益(百万円)	5,940
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,940
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,640
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、 2016年度ストックオプション(1)2,085,000株、 2016年度ストックオプション(2)2,793,000株、 2017年度ストックオプション(1)3,338,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	72,302
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	72,302
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,558

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もし

くは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。) または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。) と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円(2019年9月末現在)

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理) を原信託受託者から再信託受託者(日本マスタートラスト信託銀行株式会社) へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
アーク証券株式会社	2,619百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 2月 7日	有価証券届出書
2019年 2月 7日	有価証券報告書
2019年 8月 7日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年 8月 7日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注)1.上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年12月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスポートフォリオの2018年11月8日から2019年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスポートフォリオの2019年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年12月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスポートフォリオの2018年11月8日から2019年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスポートフォリオの2019年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1.上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1.上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。